NEUBERGER | BERMAN

NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC
JAHRESBERICHT 2023

GEPRÜFTER JAHRESABSCHLUSS
FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

Inhaltsverzeichnis

SEITE

GESCHÄFTSFÜHRUNG UND VERWALTUNG 1

INFORMATIONEN 4

BERICHT DER ALLGEMEINE DIREKTOREN 45

BERICHT DER VERWAHRSTELLE AN DIE ANTEILINHABER 51

BERICHT DER UNABHÄNGIGEN WIRTSCHAFTSPRÜFER AN DIE GESELLSCHAFTER DER NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC 52

BERICHT DER UNABHÄNGIGEN WIRTSCHAFTSPRÜFER AN DIE DIREKTOREN DER NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC 55

BERICHT DES INVESTMENT-MANAGERS 57

AUFSTELLUNG DES WERTPAPIERBESTANDS

Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (oder „5G Connectivity") – Aufstellung des Wertpapierbestands 114

Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund (oder „Absolute Return Multi Strategy") – Aufstellung des Wertpapierbestands 119

Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (oder „China A-Share Equity") – Aufstellung des Wertpapierbestands 120

Neuberger Berman China Bond Fund (oder „China Bond") – Aufstellung des Wertpapierbestands 122

Neuberger Berman China Equity Fund (oder „China Equity") – Aufstellung des Wertpapierbestands 126

Neuberger Berman Climate Innovation Fund (oder „Climate Innovation") – Aufstellung des Wertpapierbestands 129

Neuberger Berman CLO Income Fund (oder „CLO Income") – Aufstellung des Wertpapierbestands 132

Neuberger Berman Commodities Fund (oder „Commodities") – Aufstellung des Wertpapierbestands 137

Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (oder „Corporate Hybrid Bond") – Aufstellung des Wertpapierbestands 140

Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 (oder „Developed Market FMP – 2027") – Aufstellung des Wertpapierbestands 145

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (oder „Emerging Market Debt - Hard Currency") – Aufstellung des Wertpapierbestands 148

Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund (oder „Emerging Market Debt - Local Currency") – Aufstellung des Wertpapierbestands 160

Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (oder „Emerging Market Debt Blend") – Aufstellung des Wertpapierbestands 175

Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund (oder „Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend") – Aufstellung des Wertpapierbestands 200

Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (oder „Emerging Markets Equity") – Aufstellung des Wertpapierbestands 213

Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

SEITE

Neuberger Berman Euro Bond Fund (oder „Euro Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 219

Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (oder „Euro Bond Absolute Return“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 225

Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (oder „European High Yield Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 232

Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (oder „European Sustainable Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 240

Neuberger Berman Event Driven Fund (oder „Event Driven“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 242

Neuberger Berman Global Bond Fund (oder „Global Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 244

Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024 Fund (oder „Global Diversified Income FMP – 2024“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 265

Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund (oder „Global Equity Megatrends“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 268

Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund (oder „Global Flexible Credit Income“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 270

Neuberger Berman Global SDG Engagement Fund (oder „Global SDG Engagement“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 286

Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (oder „Global Investment Grade Credit“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 305

Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (oder „Global Opportunistic Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 314

Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (oder „Global Real Estate Securities“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 334

Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (oder „Global Sustainable Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 338

Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund (oder „Global Sustainable Value“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 340

Neuberger Berman High Yield Bond Fund (oder „High Yield Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 349

Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund (oder „InnovAsia 5G“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 367

Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (oder „Japan Equity Engagement“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 371

Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund (oder „Macro Opportunities FX“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 375

Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (oder „Next Generation Mobility“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 381

Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund (oder „Next Generation Space Economy“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 385

Neuberger Berman Responsible Asian Debt - Hard Currency Fund (oder „Responsible Asian Debt - Hard Currency“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 388

Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

SEITE

Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (oder „Short Duration Emerging Market Debt“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 396

Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund (oder „Short Duration High Yield SDG Engagement“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 408

Neuberger Berman Strategic Income Fund (oder „Strategic Income“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 419

Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (oder „Sustainable Asia High Yield“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 456

Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund (oder „Sustainable Emerging Market Corporate Debt“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 460

Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Fund (oder „Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 470

Neuberger Berman Tactical Macro Fund (oder „Tactical Macro“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 476

Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund (oder „Ultra Short Term Euro Bond“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 479

Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund (oder „Uncorrelated Strategies“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 490

Neuberger Berman US Equity Fund (oder „US Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 641

Neuberger Berman US Equity Index PutWrite Fund (oder „US Equity Index PutWrite“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 644

Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (oder „US Large Cap Value“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 647

Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (oder „US Long Short Equity“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 651

Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (oder „US Multi Cap Opportunities“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 659

Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (oder „US Real Estate Securities“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 662

Neuberger Berman US Small Cap Fund (oder „US Small Cap“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 666

Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (oder „US Small Cap Intrinsic Value“) – Aufstellung des Wertpapierbestands 671

BILANZEN 675

GEWINN- UND VERLUSTRECHNUNG 690

AUFSTELLUNG ÜBER DIE ENTWICKLUNG DES AUF INHABER RÜCKZAHLBARER, GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGENS 705

AUFSTELLUNG DER WESENTLICHEN KÄUFE UND VERKÄUFE (UNGEPRÜFT) 713

Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

SEITE

ANMERKUNGEN ZUM GEPRÜFTEN JAHRESABSCHLUSS 829

WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE 829
Finanzvermögen und -verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet 838
Barmittel und Barmitteläquivalente 869
Kontenüberziehung 889
Anteilkapital 889
Gebühren des Managers, der Verwaltungsstelle, der Vertriebsstelle und der Verwahrstelle 1004
Honorare und Aufwendungen der Direktoren 1028
Vergütung der Abschlussprüfer 1028
Sonstige Gebühren und Kosten 1028
Transaktionen verbundener Parteien 1029
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten 1048
Angaben zu Finanzinstrumenten 1077
Vergleichszahlen für den Nettoinventarwert 1240
Wechselkurse 1347
Berichtigung der Währungsumrechnung 1349
Vereinbarungen über Verrechnungsprovisionen (Soft Commissions) 1349
Getrennte Haftung 1349
Effizientes Portfoliomanagement 1349
Kreditfazilität 1350
Ungedeckte Kreditzusagen 1350
Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres 1351
Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres 1352
Genehmigung des Abschlusses 1353
Finanzkennzahlen 1354
Derivative Kontrakte 1518
Saldierung von Finanzinstrumenten 1539
Geschlossene Fonds 1633

ANHANG I – GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) 1634

ANHANG II – PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) 1664

ANHANG III – INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT) 1690

ANHANG IV – VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (UNGEPRÜFT) 1692

ANHANG V – ANGABEN ZUR VERGÜTUNG (UNGEPRÜFT) 1708

ANHANG VI – GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) 1709

ANHANG VII – INVESTMENT-MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) 1715

ANHANG VIII – OFFENLEGUNGSVERORDNUNG (UNGEPRÜFT) 1719

Geschäftsführung und Verwaltung

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

Direktoren:
Tom Finlay (Ire)** (in Ruhestand am 30. Juni 2023)
Gráinne Alexander (Irin)***
Michelle Green (Britin)*
Naomi Daly (Irin)****
Alex Duncan (Brite)*

*Nicht geschäftsführender Direktor
**Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor und Vorsitzender
***Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor
****Unabhängige, nicht geschäftsführende Direktorin und Vorsitzende (ab dem 1. Juli 2023)

Rechtsberater für irisches Recht:
Matheson LLP
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irland

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

Manager:
Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited
2 Central Plaza
Dame Street
Dublin 2
Irland

Vertriebsstellen und Sub-Investment-Manager:
Neuberger Berman Asia Limited
20th Floor
Jardine House
1 Connaught Place
Central Hong Kong

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

Vertriebsstellen und Sub-Investment-Manager (Fortsetzung):
Neuberger Berman Europe Limited
The Zig Zag Building
70 Victoria Street
London SW1E 6SQ
England

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

Nicht verbundener Unterberater:
Neuberger Berman Fund Management (China) Limited
Unit 11, 30F
No.88 Central Avenue
China (Shanghai) Pilot Free Trade Zone, 200120
Volksrepublik China

Neuberger Berman Information Consulting (Shanghai) Limited (formerly Neuberger Berman Investment Management (Shanghai) Limited)
20/F, HKRI Centre Two, 288 Shimen Yi Road
Jing'an District, Shanghai 200041
Volksrepublik China

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

Unabhängige Wirtschaftsprüfer:
Ernst & Young
Chartered Accountants
Harcourt Centre
Harcourt Street
Dublin 2
Irland

Geschäftsführung und Verwaltung (Fortsetzung)

Vertreter in der Schweiz:****
BNP PARIBAS, Paris, Zurich branch
Selnaustrasse 16
P.O. Box CH-8002
Zürich
Schweiz

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

Secretary des Fonds und eingetragener Geschäftssitz:
Matsack Trust Limited
70 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2
Irland

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

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

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

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

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

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

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

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

Altiq LLP
29 Farm Street
London W1J 5RL
Großbritannien

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

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

Alcova Asset Management LLP
(aufgelöst am 5. Oktober 2023)
21 Knightsbridge
London SW1X 7LY
Großbritannien

Sandbar Asset Management LLP
(aufgelöst am 15. Dezember 2023)
Warnford Court
14-15 Conduit Street
London W1S 2XJ
Großbritannien

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

Geschäftsführung und Verwaltung (Fortsetzung)

Nicht verbundene Unterberater (Fortsetzung):
Cipher Capital LP
(ernannt zum 23. November 2023)
400 Madison Ave, Suite 12-A
New York, NY 10017
USA

G10 Capital Limited
(ernannt zum 22. November 2023)
4th Floor
3 More London Riverside
London SE21 2AQ
Großbritannien

Nicht verbundene Unterberater (Fortsetzung):
Crabel Capital Management, LLC
10250 Constellation Blvd., Suite 2650
Los Angeles, CA 90067
USA

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

Allgemeine Informationen

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

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

Am 31. Dezember 2023 umfasste der Fonds 53 separate Anlageportfolios („Portfolios"), die jeweils mehrere Serien rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile repräsentierten. Diese werden in der nachstehenden Tabelle angegeben:

Portfolio	Auflegungsdatum*	SFDR-Kategorie**
5G Connectivity[1]	8. April 2020	Artikel 8
China A-Share Equity[2]	28. Juli 2020	Artikel 8
China Bond[1]	28. August 2015	Artikel 8
China Equity[1]	14. Juli 2009	Artikel 6
Climate Innovation[2]	1. August 2023	Artikel 8
CLO Income[2]	12. Juli 2018	Artikel 6
Commodities[2]	9. Februar 2022	Artikel 6
Corporate Hybrid Bond[2]	19. November 2015	Artikel 8
Developed Market FMP – 2027[2]	31. Juli 2023	Artikel 8
Emerging Market Debt – Hard Currency[1]	31. Mai 2013	Artikel 8
Emerging Market Debt – Local Currency[1]	28. Juni 2013	Artikel 8
Emerging Market Debt Blend[1]	23. April 2014	Artikel 8
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend[2]	10. Juli 2017	Artikel 8
Emerging Markets Equity[1]	4. Oktober 2010	Artikel 8
Euro Bond[2]	14. November 2018	Artikel 8
Euro Bond Absolute Return[2]	29. November 2018	Artikel 8
European High Yield Bond[1]	27. Juni 2014	Artikel 8
European Sustainable Equity[1]	24. Februar 2021	Artikel 8
Event Driven[2]	26. Oktober 2022	Artikel 6
Global Bond[1]	16. Juli 2012	Artikel 8
Global Diversified Income FMP – 2024[2]	22. Juni 2020	Artikel 8
Global Equity Megatrends[1]	27. April 2018	Artikel 8
Global Flexible Credit Income[2]	1. Juni 2020	Artikel 8
Global SDG Engagement[2]	4. August 2016	Artikel 8
Global Investment Grade Credit[2]	1. September 2021	Artikel 8
Global Opportunistic Bond[2]	20. Dezember 2016	Artikel 8
Global Real Estate Securities[1]	30. Dezember 2014	Artikel 8
Global Sustainable Equity[1]	24. Februar 2021	Artikel 8
Global Sustainable Value[2]	18. Dezember 2014	Artikel 8

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Portfolio	Auflegungsdatum*	SFDR-Kategorie**
High Yield Bond[1]	3. Mai 2006	Artikel 8
InnovAsia 5G[2]	14. Juli 2021	Artikel 8
Japan Equity Engagement[2]	12. Mai 2020	Artikel 8
Macro Opportunities FX[2]	4. Dezember 2019	Artikel 6
Next Generation Mobility[1]	21. August 2018	Artikel 8
Next Generation Space Economy[1]	10. Mai 2022	Artikel 8
Responsible Asian Debt – Hard Currency[1]	29. Juni 2015	Artikel 8
Short Duration Emerging Market Debt[1]	31. Oktober 2013	Artikel 8
Short Duration High Yield SDG Engagement[1]	20. Dezember 2011	Artikel 8
Strategic Income[1]	26. April 2013	Artikel 8
Sustainable Asia High Yield[1]	13. Dezember 2021	Artikel 8
Sustainable Emerging Market Corporate Debt[1]	14. Juni 2013	Artikel 8
Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency[2]	19. Januar 2022	Artikel 9
Tactical Macro[2]	30. Juni 2023	Artikel 6
Ultra Short Term Euro Bond[2]	31. Oktober 2018	Artikel 8
Uncorrelated Strategies[2]	22. Mai 2017	Artikel 6
US Equity[2]	18. Dezember 2015	Artikel 8
US Equity Index PutWrite[2]	30. Dezember 2016	Artikel 6
US Large Cap Value[1]	20. Dezember 2021	Artikel 8
US Long Short Equity[2]	28. Februar 2014	Artikel 8
US Multi Cap Opportunities[1]	13. Juni 2006	Artikel 8
US Real Estate Securities[1]	1. Februar 2006	Artikel 8
US Small Cap[1]	1. Juli 2011	Artikel 8
US Small Cap Intrinsic Value[2]	30. April 2015	Artikel 6

*Erster Tag des Geschäftsbetriebs.
Nähere Angaben zur Sustainable Finance Disclosure Regulation entnehmen Sie bitte Anahng VIII.

[1] Das Portfolio ist von der Hong Kong Securities and Futures Commission (die „SFC") autorisiert und kann somit für die Öffentlichkeit in Hongkong angeboten werden.
[2] Das Portfolio ist von der Securities and Futures Commission (SFC) nicht zugelassen und für Anleger in Hongkong nicht verfügbar

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

Der Neuberger Berman Uncorrelated Trading Fund (oder „Uncorrelated Trading"), der Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (oder „Global High Yield Sustainable Action"), der Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund (oder „Multi-Asset Income") und der Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund (oder „Emerging Markets Select Equity") wurden am 24. Mai 2023, 16. Juni 2023, 6. Juli 2023 beziehungsweise 7. September 2023 aufgelöst und stehen daher nicht mehr zur Zeichnung zur Verfügung. Der Neuberger Berman Diversified Currency Fund, der Neuberger Berman Multi-Style Premia Fund, der Neuberger Berman Absolute Return Multi Strategy Fund und der Neuberger Berman Global Equity Index PutWrite Fund wurden in den vorangegangenen Berichtsjahren aufgelöst und stehen daher nicht mehr zur Zeichnung zur Verfügung. Der Neuberger Berman Multi-Asset Growth Fund, der Neuberger Berman Global Equity Fund, der Neuberger Berman Absolute Alpha Fund, der Neuberger Berman Global Bond Absolute Return Fund und der Neuberger Berman China Equity Opportunities Fund wurden in den vorangegangenen Berichtsjahren aufgelöst und ihre Zulassung wurde von der Zentralbank am 19. Mai 2023 widerrufen.

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

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

Anlageziele und eine Liste der aktiven Anteilklassen der Portfolios, die zum 31. Dezember 2023 zur Anlage verfügbar waren, sind im folgenden beschrieben:

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

5G Connectivity

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

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

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

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse AUD A[1]	20. Mai 2020	AUD
Thesaurierende Klasse AUD I2	13. September 2023	AUD
Thesaurierende Klasse CHF A	1. August 2023	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I	1. August 2023	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I2	13. September 2023	CHF
Thesaurierende Klasse CNY A	1. Februar 2021	CNY
Thesaurierende Klasse CNY I2	13. September 2023	CNY
Thesaurierende Klasse EUR A[1]	13. Mai 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	22. April 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	30. Juni 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	12. Juni 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	13. September 2023	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	1. September 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	22. April 2020	EUR
Thesaurierende Klasse GBP A[1]	15. Mai 2020	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	2. November 2020	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	13. September 2023	GBP
Thesaurierende Klasse HKD A[1]	13. Mai 2020	HKD
Thesaurierende Klasse HKD I2	13. September 2023	HKD
Thesaurierende Klasse SGD A[1]	14. Mai 2020	SGD
Thesaurierende Klasse SGD I2	13. September 2023	SGD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	4. Mai 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD E	1. Februar 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD I	8. April 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD I	8. April 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	10. März 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I3	6. November 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	7. Mai 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD M	2. Juni 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	19. März 2021	USD
Thesaurierende Klasse ZAR A[1]	14. Februar 2023	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR E	10. Februar 2023	ZAR

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

China A-Share Equity

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse CNY I	28. Juli 2020	CNY
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	28. Juli 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	28. Juli 2020	USD

China Bond

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

China Equity

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

China Equity (Fortsetzung)

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

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

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Klimainnovation

Das Anlageziel des Climate Innovation (das „Portfolio") ist es, einen langfristigen Kapitalzuwachs zu erzielen, indem er hauptsächlich in ein Portfolio aus globalen Beteiligungspapieren investiert. Der Schwerpunkt liegt dabei auf Unternehmen, die an Technologien und/oder Aktivitäten im Zusammenhang mit Klimainnovation beteiligt sind oder daraus Nutzen ziehen.

Das Portfolio ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem es vorrangig in Aktienwerte investiert, die weltweit an anerkannten Märkten (zu denen auch Schwellenländer gehören können) notiert sind oder gehandelt werden und von Unternehmen mit beliebiger Marktkapitalisierungen aus allen Wirtschaftssektoren begeben werden. Das Portfolio kann in Unternehmen mit beliebiger Marktkapitalisierung investieren.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Climate Innovation (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse USD A	1. August 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD I	1. August 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	1. August 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	1. August 2023	USD

CLO Income

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR A	9. Juni 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	12. Juli 2018	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I2	15. November 2018	EUR
Thesaurierende Klasse GBP Z	12. Dezember 2019	GBP
Thesaurierende Klasse SEK I	12. Juli 2018	SEK
Thesaurierende Klasse USD A	9. Juni 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I	12. Juli 2018	USD
Ausschüttende Klasse USD I	17. August 2023	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	21. März 2019	USD
Ausschüttende Klasse USD I5	12. Juli 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	18. April 2019	USD

Commodities

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

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Commodities (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Corporate Hybrid Bond

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	23. September 2016	AUD
Thesaurierende Klasse CHF P	27. April 2017	CHF
Ausschüttende Klasse CHF P	17. Juni 2016	CHF
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	18. Juli 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A	3. Juni 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	19. November 2015	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	19. November 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	3. Februar 2017	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I2	24. Dezember 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I3	13. September 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	19. November 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	18. Februar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse EUR M	13. Februar 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR P	27. April 2017	EUR
Ausschüttende Klasse EUR P	24. Juni 2016	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	9. März 2017	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	15. Mai 2017	GBP

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse GBP I2	24. August 2016	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P	16. August 2019	GBP
Ausschüttende Klasse GBP P	19. Mai 2017	GBP
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	2. August 2019	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	18. Juli 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD A	10. August 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD A	23. April 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	13. Dezember 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	14. Juni 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD I	23. April 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	3. Februar 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	3. Februar 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD M	15. Dezember 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	15. Dezember 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD P	5. Mai 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	20. Januar 2017	USD

Developed Market FMP – 2027

Das Anlageziel des Developed Market FMP – 2027 (das „Portfolio") ist die Maximierung der laufenden Erträge während der Laufzeit des Portfolios, indem in eine diversifizierte Mischung aus globalen festverzinslichen Wertpapieren, einschließlich hochverzinslicher Wertpapiere, investiert wird.

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR A	31. Juli 2023	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	15. September 2023	EUR
Thesaurierende Klasse USD A	31. Juli 2023	USD
Ausschüttende Klasse USD A	31. Juli 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD I	31. Juli 2023	USD
Ausschüttende Klasse USD I	21. August 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD X	31. Juli 2023	USD
Ausschüttende Klasse USD X	31. Juli 2023	USD

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Hard Currency

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse USD A[1]	31. Mai 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD A	30. Oktober 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	24. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	31. Mai 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I	31. Mai 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	15. November 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	20. April 2018	USD
Ausschüttende Klasse USD I3	20. März 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD M	25. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	15. September 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD P	11. Januar 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD X	16. Dezember 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	26. April 2017	USD

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Emerging Market Debt – Local Currency

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	2. November 2016	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	25. Januar 2021	GBP
Thesaurierende Klasse SEK A	5. November 2015	SEK
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)[1]	4. März 2015	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)[1]	31. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	28. Juni 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	4. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD B	4. Juni 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	4. Juni 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	4. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD E	4. Juni 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	2. September 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I	28. Juni 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I	14. Oktober 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	13. August 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	26. September 2018	USD
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	31. März 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD T	4. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD X	23. Oktober 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD Y	14. Januar 2021	USD
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	5. Juni 2015	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR B	5. Juni 2015	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	5. Juni 2015	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR C2	5. Juni 2015	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	5. Juni 2015	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR E	5. Juni 2015	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	5. Juni 2015	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR T	5. Juni 2015	ZAR

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Emerging Market Debt Blend

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse AUD I3	6. November 2019	AUD
Thesaurierende Klasse EUR A[1]	4. Dezember 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	8. Juli 2014	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	19. Juni 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	27. Mai 2014	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I2	24. Februar 2015	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I3	5. November 2019	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	23. März 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	23. April 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z	2. Juni 2014	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	31. März 2016	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	12. April 2017	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I	22. Mai 2018	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22. Mai 2018	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P	13. Mai 2019	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	13. Mai 2019	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Z	17. März 2016	GBP
Thesaurierende Klasse NOK U	13. März 2017	NOK
Thesaurierende Klasse SEK A	5. November 2015	SEK
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)[1]	15. September 2017	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)[1]	15. September 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	4. Februar 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	24. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	23. April 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I	1. Juni 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	24. Februar 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	24. Juli 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD M	25. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	26. September 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	28. September 2015	USD

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse AUD I2	16. Februar 2021	AUD
Thesaurierende Klasse NOK I	9. Mai 2018	NOK
Thesaurierende Klasse NOK I3	5. September 2023	NOK
Thesaurierende Klasse USD I	10. Juli 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	16. März 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	2. November 2017	USD

Emerging Markets Equity

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

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse AUD B	30. November 2016	AUD
Thesaurierende Klasse AUD C2	30. November 2016	AUD
Thesaurierende Klasse AUD E	30. November 2016	AUD
Thesaurierende Klasse AUD T	30. November 2016	AUD
Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)	24. Januar 2018	CAD

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse CAD I2	17. Dezember 2021	CAD
Thesaurierende Klasse EUR I	4. Oktober 2010	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	18. Februar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z	5. Februar 2018	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	15. Januar 2014	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Z	17. März 2016	GBP
Thesaurierende Klasse USD A[1]	4. Oktober 2010	USD
Thesaurierende Klasse USD B	30. November 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD C2	30. November 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD E	30. November 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD I	4. Oktober 2010	USD
Thesaurierende Klasse USD M	27. Mai 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD T	30. November 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	30. Juni 2014	USD
Thesaurierende Klasse ZAR B	30. November 2016	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR C2	30. November 2016	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR E	30. November 2016	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR T	30. November 2016	ZAR

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Euro Bond

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR I	14. November 2018	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	14. November 2018	EUR

Euro Bond Absolute Return

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

European High Yield Bond

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse CHF I	14. März 2023	CHF
Thesaurierende Klasse EUR I	27. Juni 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	8. November 2023	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	22. November 2023	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR X	20. Februar 2018	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Y	4. Januar 2023	EUR
Ausschüttende Klasse EUR Y	27. Juni 2023	EUR
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)[1]	31. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD I	27. Juni 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD X	12. Januar 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	26. April 2019	USD

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

European Sustainable Equity

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Event Driven

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR I	17. Januar 2023	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I5	26. Oktober 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I5	26. Oktober 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P	26. Oktober 2022	GBP
Thesaurierende Klasse USD I	26. Oktober 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	26. Oktober 2022	USD

Global Bond

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

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Bond (Fortsetzung)

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

Der Anlage-Ansatz basiert auf vier grundlegenden differenzierenden Faktoren:

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	3. Februar 2021	AUD
Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	31. August 2023	EUR
Thesaurierende Klasse USD C1	3. Januar 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	26. September 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I	16. Juli 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD M	2. Juli 2018	USD
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	3. Februar 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	20. Januar 2017	USD
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	3. Februar 2021	ZAR

Global Diversified Income FMP – 2024

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR A	7. Juli 2020	EUR
Ausschüttende Klasse EUR A	10. Juli 2020	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	29. Juli 2020	EUR
Ausschüttende Klasse GBP I	22. Juni 2020	GBP
Ausschüttende Klasse HKD A	28. Juli 2020	HKD
Ausschüttende Klasse SGD A	22. Juni 2020	SGD

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse USD A	22. Juni 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD A	22. Juni 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD I	22. Juni 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD I	22. Juni 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD X	22. Juni 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD X	22. Juni 2020	USD

Global Equity Megatrends

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR I	22. Dezember 2023	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	19. Oktober 2018	EUR
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	5. Juli 2023	GBP
Thesaurierende Klasse SGD A[1]	8. Dezember 2023	SGD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	27. April 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	27. April 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD I	27. April 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD M	27. April 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	25. Februar 2022	USD

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Global Flexible Credit Income

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse CAD I5	18. März 2021	CAD
Thesaurierende Klasse EUR I	29. September 2020	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	13. August 2020	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I5	1. Juni 2020	GBP

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse USD A	16. September 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD I	1. Juni 2020	USD
Ausschüttende Klasse USD I	1. Juni 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD M	16. September 2020	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	1. Juni 2020	USD

Global SDG Engagement

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

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

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Investment Grade Credit

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR I	27. Juli 2023	EUR
Thesaurierende Klasse USD I	1. September 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD X	1. September 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	1. September 2021	USD

Global Opportunistic Bond

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Real Estate Securities

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Global Sustainable Equity

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

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Global Sustainable Equity (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Global Sustainable Value

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	27. September 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	20. Oktober 2023	GBP
Thesaurierende Klasse USD A	14. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	18. Dezember 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD I3	31. Mai 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	24. Mai 2016	USD

High Yield Bond

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

- hochverzinsliche Festzinsanlagen, die von Unternehmen in den USA und außerhalb der USA emittiert werden, die ihren Hauptsitz in den USA haben oder einen überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in den USA ausüben, sowie
- hochverzinsliche Festzinspapiere, die von Regierungen und staatlichen Stellen weltweit emittiert werden und vorwiegend auf US-Dollar lauten, die an anerkannten Märkten notiert oder gehandelt werden.

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)[1]	5. September 2012	AUD
Thesaurierende Klasse AUD A[1]	28. August 2012	AUD
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	22. Juli 2013	AUD
Thesaurierende Klasse AUD B	10. Dezember 2020	AUD
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	19. Juli 2013	AUD
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	2. Juli 2014	AUD
Thesaurierende Klasse AUD E	2. Juli 2014	AUD
Ausschüttende Klasse AUD I	29. Dezember 2011	AUD
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	27. Juni 2013	AUD
Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	11. Juni 2013	AUD
Thesaurierende Klasse AUD T	2. August 2013	AUD
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)[1]	23. Juli 2013	CAD
Thesaurierende Klasse CHF A	5. Juli 2011	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I	27. Mai 2011	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I2	22. Oktober 2013	CHF
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1. August 2012	CNY
Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)	9. November 2012	CNY
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)[1]	19. Juni 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A[1]	3. Mai 2006	EUR
Ausschüttende Klasse EUR A[1]	24. Februar 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	9. November 2009	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	18. Oktober 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	5. Dezember 2012	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I2	5. Dezember 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR Z	5. November 2014	EUR
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)[1]	7. Juli 2014	GBP
Thesaurierende Klasse GBP A[1]	27. April 2011	GBP
Ausschüttende Klasse GBP A[1]	24. Februar 2012	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I	27. Juli 2010	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I	8. November 2006	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	5. Dezember 2012	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I2	5. Dezember 2012	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Z	17. März 2016	GBP
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)[1]	14. September 2012	HKD
Thesaurierende Klasse SEK A	16. Juni 2011	SEK
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)[1]	30. März 2012	SGD
Thesaurierende Klasse SGD A[1]	9. März 2012	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)[1]	2. Mai 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)[1]	22. Januar 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	11. Januar 2010	USD

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse USD A[1]	24. Februar 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	31. Oktober 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD B	31. Oktober 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD C	21. November 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	25. Oktober 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD C1	7. September 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	31. Oktober 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD C2	31. Oktober 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	2. Juli 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD E	2. Juli 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	13. September 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD I	3. Mai 2006	USD
Ausschüttende Klasse USD I	16. November 2009	USD
Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)	24. September 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	5. Dezember 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	5. Dezember 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	1. Juni 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD M	18. Februar 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD M	1. März 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD P	9. Januar 2018	USD
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	31. Oktober 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)	11. Juni 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD T	31. Oktober 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)	2. Mai 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD U	9. Oktober 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	2. Mai 2014	USD
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	11. Juni 2013	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	11. Juni 2013	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	2. Juli 2014	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR E	2. Juli 2014	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	11. Juni 2013	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR T	19. Dezember 2016	ZAR

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

InnovAsia 5G

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

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

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

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Japan Equity Engagement

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse EUR I5	10. Februar 2022	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I5	22. September 2021	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	6. Juli 2023	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	11. November 2021	GBP
Thesaurierende Klasse JPY I	12. Mai 2020	JPY
Ausschüttende Klasse JPY I	12. Mai 2020	JPY
Thesaurierende Klasse JPY I5	16. Februar 2021	JPY
Thesaurierende Klasse JPY Z	28. April 2021	JPY

Macro Opportunities FX

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Next Generation Mobility

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Next Generation Space Economy

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Responsible Asian Debt – Hard Currency

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)[1]	30. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	30. Juni 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	15. Oktober 2019	USD

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Responsible Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse USD I	30. Juni 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD I	30. Juni 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	23. September 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I4	23. September 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD M	14. August 2019	USD
Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	23. September 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD X	8. Juni 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	12. Dezember 2022	USD

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Short Duration Emerging Market Debt

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)[1]	31. August 2016	AUD
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)[1]	6. November 2015	CAD
Thesaurierende Klasse CHF A	6. Juni 2014	CHF
Ausschüttende Klasse CHF A	6. Juni 2014	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I	6. Juni 2014	CHF
Ausschüttende Klasse CHF I	13. Juni 2014	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I2	20. Februar 2015	CHF
Ausschüttende Klasse CHF I2	18. April 2017	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I5	31. März 2014	CHF
Thesaurierende Klasse CHF P	25. April 2017	CHF
Thesaurierende Klasse EUR A[1]	13. Juni 2014	EUR
Ausschüttende Klasse EUR A	6. Juni 2014	EUR

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR I	6. Juni 2014	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I	6. Juni 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	23. Juni 2014	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I2	30. März 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5	14. März 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR P	23. Februar 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR U	6. Juni 2018	EUR
Ausschüttende Klasse EUR X	16. März 2020	EUR
Thesaurierende Klasse GBP A[1]	22. November 2016	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I	16. Dezember 2016	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I	20. Februar 2018	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	30. September 2016	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I2	19. Oktober 2017	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I5	11. April 2014	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P	13. August 2019	GBP
Thesaurierende Klasse JPY I	23. Februar 2015	JPY
Ausschüttende Klasse JPY I	22. September 2014	JPY
Thesaurierende Klasse SEK A	2. Februar 2018	SEK
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)[1]	31. Oktober 2014	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)[1]	31. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	6. Dezember 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD A	6. Juni 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	29. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD C1	29. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	31. Oktober 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I	2. Juni 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	12. September 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	30. Oktober 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	19. März 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I5	9. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD M	24. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	29. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD P	10. August 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	1. April 2014	USD

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Short Duration High Yield SDG Engagement

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

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

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)[1]	11. Juni 2013	AUD
Thesaurierende Klasse CHF A	9. März 2012	CHF
Thesaurierende Klasse CHF I	20. Dezember 2011	CHF
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1. August 2012	CNY
Thesaurierende Klasse EUR A[1]	20. Dezember 2011	EUR
Ausschüttende Klasse EUR A[1]	14. Februar 2014	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	20. Dezember 2011	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	5. Dezember 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	17. Januar 2012	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I	20. Dezember 2011	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	5. Dezember 2012	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I2	5. Dezember 2012	GBP
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	21. September 2022	HKD
Thesaurierende Klasse JPY I	28. März 2012	JPY
Ausschüttende Klasse JPY I	19. Oktober 2022	JPY
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)[1]	17. Januar 2014	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)[1]	22. Januar 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	20. Dezember 2011	USD
Ausschüttende Klasse USD A[1]	30. November 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	2. Oktober 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	20. Dezember 2011	USD
Ausschüttende Klasse USD I	9. Januar 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	5. Dezember 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD I2	5. Dezember 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD I4	10. Mai 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	8. September 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD M	25. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	20. Dezember 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	1. April 2014	USD

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Strategic Income

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)[1]	15. September 2017	AUD
Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)	1. Juli 2019	AUD
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)[1]	31. Mai 2023	CNY
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)[1]	7. August 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A[1]	14. November 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	22. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)[1]	15. September 2017	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)	6. Dezember 2023	GBP
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)[1]	15. September 2017	HKD
Thesaurierende Klasse JPY I	26. April 2013	JPY
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	26. April 2013	JPY
Ausschüttende Klasse JPY I CG	10. August 2015	JPY
Ausschüttende Klasse JPY I	25. Juni 2014	JPY
Thesaurierende Klasse JPY Z	1. April 2022	JPY
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)[1]	31. Oktober 2014	SGD
Thesaurierende Klasse SGD A[1]	15. September 2017	SGD
Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)	4. Juni 2018	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)[1]	31. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	11. Februar 2015	USD
Ausschüttende Klasse USD A	10. August 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	25. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	26. April 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I	10. Dezember 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD M	18. Februar 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD M	25. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	30. Juni 2014	USD

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield

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

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

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

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

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

- eine geringe CO2-Emissionsintensität aufweisen. Das Portfolio strebt eine Reduzierung der CO2-Emissionen von mindestens 30 % gegenüber dem breiteren Anlageuniversum asiatischer Hochzinsanleihen an, das durch den JPMorgan Asian Credit High Yield Index (der „Index") repräsentiert wird; und
- bessere ESG-Praktiken (Umwelt, Soziales und Governance) unter Beweis stellen. Das Portfolio strebt, basierend auf den ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters, eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Hochzinsanleihen an, das durch den Index repräsentiert wird.

Das Ziel einer geringeren CO2-Emissionsintensität soll dazu dienen, die langfristigen Ziele des Pariser Übereinkommens in Bezug auf die globale Erwärmung zu erreichen.

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR X	28. Januar 2022	EUR
Thesaurierende Klasse GBP X	8. April 2022	GBP
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)[1]	13. Dezember 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	13. Dezember 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I	13. Dezember 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	21. Januar 2022	USD
Ausschüttende Klasse USD Z	22. März 2022	USD

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse CHF I	28. Juni 2013	CHF
Thesaurierende Klasse EUR A[1]	17. Dezember 2015	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	28. Juni 2013	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I3	29. Juli 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	18. Februar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse EUR M	18. Februar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR X	20. Juli 2015	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	28. Juni 2013	GBP
Thesaurierende Klasse SEK A	1. Februar 2018	SEK
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)[1]	31. Oktober 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	28. Juni 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	29. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	28. Juni 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I	28. Juni 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	25. März 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD M	3. Oktober 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD M	3. November 2017	USD

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency

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

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR I3	26. September 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I4	13. April 2023	EUR
Thesaurierende Klasse EUR X	19. Januar 2022	EUR
Thesaurierende Klasse USD I	19. Januar 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	27. Januar 2022	USD

Tactical Macro

Das Anlageziel desTactical Macro (das „Portfolio") ist es, ungeachtet des Marktumfelds positive Erträge zu erzielen durch die Ermittlung von Missverhältnissen bei den Marktpreisen für ein breites Spektrum von Anlageklassen, Märkten und Regionen im Rahmen ausgeprägter Risikosteuerung.

Um dieses Ziel zu erreichen, werden wesentliche Aspekte des makroökonomischen Umfelds ermittelt, um auf der Grundlage der Analysen wesentlicher Aspekte des makroökonomischen Umfelds, die zur Auswahl von Anlagen herangezogen werden, ein Universum von Investmentthesen zu entwickeln.

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse USD I	30. Juni 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	30. Juni 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	30. Juni 2023	USD

Ultra Short Term Euro Bond

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse CHF I	13. März 2018	CHF
Thesaurierende Klasse EUR A	20. August 2018	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	6. März 2018	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I2	6. Juli 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	15. September 2017	EUR
Thesaurierende Klasse EUR P	5. Juli 2022	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	30. Juni 2017	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2	6. Juli 2017	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I2	30. August 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I5	31. Mai 2017	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P	2. Oktober 2018	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Z	29. Juni 2017	GBP
Thesaurierende Klasse JPY I	1. April 2022	JPY
Thesaurierende Klasse SGD A	21. Dezember 2022	SGD
Thesaurierende Klasse USD A	26. Januar 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	6. März 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD I	31. Mai 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	6. Juli 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	31. Mai 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD M	9. August 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD P	12. Dezember 2018	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	8. September 2017	USD

US Equity

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Equity Index PutWrite

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR I	13. Februar 2017	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I3	3. Dezember 2021	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I4	28. April 2017	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I4	15. Dezember 2023	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	13. Februar 2017	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	2. März 2017	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I3	11. Mai 2021	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I3	3. Dezember 2021	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	21. Juni 2023	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	25. Oktober 2017	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I4	29. November 2023	GBP
Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	25. August 2021	GBP
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	15. August 2017	SGD
Thesaurierende Klasse USD A	23. Januar 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	18. Mai 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD I	30. Dezember 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD I3	3. Dezember 2021	USD
Thesaurierende Klasse USD I4	28. April 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD M	13. Februar 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	10. Februar 2017	USD

US Large Cap Value

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse EUR A[1]	19. Oktober 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	21. Juni 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	30. März 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	19. April 2022	EUR
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	22. März 2022	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	27. Januar 2022	EUR
Thesaurierende Klasse GBP I	22. November 2022	GBP

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22. November 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I	22. November 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22. November 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	14. März 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	8. Juni 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP P	21. Oktober 2022	GBP
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	24. Mai 2022	GBP
Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	30. August 2022	GBP
Thesaurierende Klasse USD A[1]	24. März 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I	20. Dezember 2021	USD
Ausschüttende Klasse USD I4	21. März 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD I5	11. Februar 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD M	25. März 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD Y	8. August 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	23. Mai 2022	USD

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

US Long Short Equity

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Multi Cap Opportunities

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse AUD E	2. Juli 2014	AUD
Thesaurierende Klasse AUD T	19. Dezember 2016	AUD
Thesaurierende Klasse EUR I3	21. März 2013	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Thesaurierende Klasse EUR1 A	28. Juni 2012	EUR
Thesaurierende Klasse EUR1 I	28. Juni 2012	EUR
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	6. November 2017	GBP
Thesaurierende Klasse SGD A[1]	16. Juli 2013	SGD
Thesaurierende Klasse USD B	22. November 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	13. Oktober 2017	USD
Thesaurierende Klasse USD C2	22. November 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD E	2. Juli 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	24. Mai 2023	USD
Thesaurierende Klasse USD I3	29. April 2013	USD
Ausschüttende Klasse USD I3	30. Juli 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD M	18. Februar 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD T	22. November 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD U	22. Januar 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	2. Mai 2014	USD
Thesaurierende Klasse USD1 A	29. Juni 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD1 I	28. Juni 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD1 I	29. Juni 2012	USD
Thesaurierende Klasse ZAR B	13. Januar 2014	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR C2	13. Januar 2014	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR E	2. Juli 2014	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR T	13. Januar 2014	ZAR

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

US Real Estate Securities

Das Anlageziel des US Real Estate Securities (das „Portfolio") ist die Erzielung einer Gesamtrendite (Total Return) insbesondere durch Kapitalzuwachs sowie aus laufenden Erträgen durch Anlagen in Immobilienwertpapieren. Um dieses Ziel zu erreichen, legt das Portfolio grundsätzlich in ein konzentriertes Portfolio von Wertpapieren (einschließlich Wandelanleihen) an, die von Immobilienaktiengesellschaften (Real Estate Investment Trusts („REITs")) ausgegeben werden. Hierbei ist zu beachten, dass das Portfolio nicht direkt Immobilien erwirbt.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)[1]	8. August 2016	AUD
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	16. August 2016	AUD
Thesaurierende Klasse AUD B	19. August 2015	AUD
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	16. August 2016	AUD
Thesaurierende Klasse AUD E	2. Juli 2014	AUD
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	13. Oktober 2015	AUD
Thesaurierende Klasse AUD T	16. Juli 2013	AUD
Thesaurierende Klasse CHF A	11. Oktober 2012	CHF
Thesaurierende Klasse EUR A[1]	1. Februar 2006	EUR
Thesaurierende Klasse EUR I	1. Februar 2006	EUR
Thesaurierende Klasse EUR M	29. Januar 2016	EUR
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)[1]	28. Juli 2016	HKD
Thesaurierende Klasse SGD A[1]	28. Mai 2013	SGD
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)[1]	18. November 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD A[1]	1. Februar 2006	USD
Ausschüttende Klasse USD A[1]	21. März 2012	USD
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	15. August 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD B	16. Juli 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD C1	31. August 2017	USD
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	15. August 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD E	2. Juli 2014	USD
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	19. November 2019	USD
Thesaurierende Klasse USD I	1. Februar 2006	USD
Ausschüttende Klasse USD I	14. Februar 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	5. Dezember 2012	USD
Thesaurierende Klasse USD M	18. Februar 2016	USD
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	31. Dezember 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD T	16. Juli 2013	USD
Thesaurierende Klasse USD Z	10. Februar 2015	USD
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	16. August 2016	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR B	13. März 2015	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR C2	11. April 2019	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	16. August 2016	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR E	2. Juli 2014	ZAR
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	11. Juni 2013	ZAR
Thesaurierende Klasse ZAR T	26. Juli 2013	ZAR

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Small Cap

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

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

Zu den Faktoren bei der Ermittlung dieser Unternehmen gehören:

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

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

[1]Zum öffentlichen Vertrieb in Hongkong zugelassen.

Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

US Small Cap Intrinsic Value

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

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

Nachstehend sind die aktiven Anteilklassen des Portfolios zum Geschäftsjahresende aufgeführt:

Name der Anteilklasse	*Auflegungsdatum der Anteilklasse*	*Währung*
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	9. März 2021	GBP
Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)	22. Oktober 2021	GBP
Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)	29. August 2023	JPY
Thesaurierende Klasse USD A	4. Februar 2016	USD
Thesaurierende Klasse USD I	30. April 2015	USD
Thesaurierende Klasse USD I2	16. März 2022	USD
Thesaurierende Klasse USD M	27. Mai 2016	USD

Bericht der Direktoren

Die Direktoren legen hiermit ihren Jahresbericht und den geprüften Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds") für das Geschäftsjahr zum Freitag, 31. Dezember 2023 sowie Vergleichszahlen für das Geschäftsjahr zum Donnerstag, 31. Dezember 2022 vor.

Aufgaben der Direktoren

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

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

Bei der Erstellung dieses Abschlusses müssen die Direktoren:

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

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

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

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

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

Erklärung zu maßgeblichen Prüfungsinformationen

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

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

Entsprechenserklärung der Direktoren

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

Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

Geschäftsbücher

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

Hauptgeschäftstätigkeit und Überblick über das Geschäft

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

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

Am 31. Dezember 2023 bestanden dreiundfünfzig Portfolios, die im Abschnitt Allgemeine Informationen dieses Jahresberichts aufgeführt sind.

Ergebnisse für das Geschäftsjahr sowie Aktiva, Passiva und Geschäftslage zum 31. Dezember 2023

Ein detaillierter Jahresrückblick und ein Rückblick auf die Faktoren, die im abgelaufenen Jahr zur Performance beigetragen haben, sind in den Berichten des Investment-Managers enthalten. Details zu den Aktiva, Passiva und der Geschäftslage des Fonds und den Ergebnissen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 sind in der Bilanz und der Gewinn- und Verlustrechnung für jedes Portfolio enthalten.

Direktoren

Die Namen und Nationalitäten der Personen, die zu irgendeinem Zeitpunkt im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 als Direktoren fungierten, sind nachstehend aufgeführt:

Tom Finlay** (in Ruhestand am 30. Juni 2023)	Ire
Gráinne Alexander***	Irin
Michelle Green*	Britin
Naomi Daly****	Irin
Alex Duncan*	Brite

*Nicht geschäftsführender Direktor
**Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor und Vorsitzender
***Unabhängiger, nicht geschäftsführender Direktor
****Unabhängige, nicht geschäftsführende Direktorin und Vorsitzende (ab dem 1. Juli 2023)

Beteiligungen der Direktoren und des Secretary des Fonds

Zum 31. Dezember 2023 sind Michelle Green und Alex Duncan Direktoren des Fonds und sind auch bei der Neuberger Berman Europe Limited („NBEL"), dem Sub-Investment-Manager und der Vertriebsstelle des Fonds, angestellt. Bis zum 15. Februar 2023 war Michelle Green auch Direktorin von NBAMIL, dem Manager der Gesellschaft. Frau Gráinne Alexander ist zudem Direktorin von NBAMIL.

Weder die Direktoren noch der Secretary des Fonds noch deren Familienangehörige halten oder hielten am 31. Dezember 2023 oder während des Geschäftsjahres ein wirtschaftliches Eigentum am Fonds. (2022: null).

Transaktionen unter Beteiligung von Direktoren

Im Berichtsjahr zum 31. Dezember 2023 gab es zu keinem Zeitpunkt Verträge oder Vereinbarungen von Bedeutung mit Bezug zum Geschäft des Fonds, an denen Direktoren oder der Secretary des Fonds im Sinne der Definition des Companies Act 2014 (in ihrer geltenden Fassung) beteiligt gewesen wären, mit Ausnahme der in Anmerkung 10 dieses Jahresabschlusses offengelegten.

Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

Transaktionen unter Beteiligung von Direktoren (Fortsetzung)

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

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

Politische Spenden

Im zum 31. Dezember 2023 endenden Jahr wurden keine politischen Spenden geleistet (2022: null).

Risikomanagementziele und -strategien

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

Ausschüttungen und Einbehaltung

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

Zukünftige Entwicklungen

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

Sonstige Sachverhalte

Die Invasion der Ukraine durch Russland und die damit zusammenhängenden Ereignisse Ende Februar 2022 haben nachteilige Auswirkungen auf Rohstoffe und die europäische Konjunktur gehabt und dies könnte weiterhin der Fall sein. Auch wenn das direkte Engagement des Fonds in Russland und der Ukraine begrenzt ist, wird die Neuberger Berman Group LLC („Neuberger Berman"), die Muttergesellschaft der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL"), weiterhin potenzielle Auswirkungen auf die Aktivitäten des Fonds überwachen, insbesondere die erhobenen russischen Sanktionen und der Anstieg bei den damit verbundenen makroökonomischen und geopolitischen Risiken.

Der Krieg zwischen Israel und den Hamas begann im Oktober 2023 und wird weiter auf potenzielle Auswirkungen auf die Aktivitäten des Fonds überwacht werden. Das Engagement des Fonds in Israel ist und bleibt unwesentlich.

Prüfungsausschuss

Der Fonds hat einen Prüfungsausschuss gegründet. Gráinne Alexander, Naomi Daly und Alex Duncan sind Direktoren des Fonds und gehören dem Prüfungsausschuss an. Zudem wurde am 17. August 2023 Herr John M. McGovern in den Prüfungsausschuss ernannt.

Wichtige Ereignisse während des Geschäftsjahres

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

Wesentliche Ereignisse seit dem Ende des Geschäftsjahres

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

Unabhängige Wirtschaftsprüfer

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

Um die Qualität und Effektivität der von den amtierenden Abschlussprüfern erbrachten Leistungen mit denen anderer Wirtschaftsprüfungsgesellschaften zu vergleichen, führte der Fonds vor kurzem ein Ausschreibungsverfahren für die Bestellung seines externen Abschlussprüfers durch, das in der Wiederbestellung von Ernst & Young zum externen Abschlussprüfer des Fonds resultierte.

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

Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

Corporate Governance

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

Corporate Governance (Fortsetzung)

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

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

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

Die Satzung sieht vor, dass die Direktoren alle Befugnisse der Gesellschaft ausüben können, Gelder aufzunehmen und die Gesellschaft, deren Eigentum oder Teile desselben zu beleihen oder zu belasten, und alle diese Befugnisse an den Manager delegieren können.

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

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

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

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

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

Zusammensetzung und Tätigkeit der Direktoren und ihrer Ausschüsse
Zurzeit gibt es 4 Direktoren, die alle nicht geschäftsführende Direktoren sind. Frau Michelle Green ist Direktorin des Fonds und war bis 15. Feburar 2023 auch bei der NBAMIL, dem Manager des Fonds, angestellt. Frau Gráinne Alexander ist zudem Direktorin von NBAMIL. Die Satzung sieht keine Ablösung der Direktoren durch Rotation vor. Die Direktoren können jedoch von den Anteilinhabern durch einfachen Mehrheitsbeschluss gemäß dem im Irish Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) festgelegten Verfahren abberufen werden. Die Direktoren kommen mindestens einmal pro Quartal zusammen. Abgesehen vom Prüfungsausschuss gibt es keine dauerhaft autorisierten Unterausschüsse der Direktoren.

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

Bericht der Direktoren (Fortsetzung)

Corporate Governance (Fortsetzung)

Unternehmensführungskodex (Corporate Governance Code) der Irish Funds
Die Irish Funds („IF") hat einen Unternehmensführungskodex (Corporate Governance Code, „IF Code") herausgegeben, den irische zugelassene Organismen für gemeinsame Anlagen auf freiwilliger Basis übernehmen können. Es ist zu beachten, dass der IF Code bestehende Praktiken der Unternehmensführung widerspiegelt, die irischen zugelassenen Organismen für gemeinsame Anlagen auferlegt wurden, wie vorstehend angemerkt. Wird der IF Code auf freiwilliger Basis übernommen, kann darauf in den Offenlegungen im Bericht der Direktoren gemäß den Bestimmungen des Irish Companies Acts von 2014 (in der jeweils geltenden Fassung) verwiesen werden.

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

Im Namen der Direktoren

Direktor:

Naomi Daly

Datum: 17. April 2024

Direktor:

Gráinne Alexander

Datum: 17. April 2024

Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber

In unserer Eigenschaft als Verwahrstelle des Fonds haben wir das Geschäftsverhalten der Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds") in dem am 31. Dezember 2023 geendeten Geschäftsjahr überprüft.

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

Aufgaben der Verwahrstelle

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

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

Grundlage des Prüfvermerks der Verwahrstelle

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

Prüfvermerk

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

(i) gemäß den Beschränkungen, die die Gründungsurkunde, die Satzung, die OGAW-Vorschriften und die Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank") den Anlage- und Kreditbefugnissen des Fonds auferlegen, und

(ii) auch sonst in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Gründungsurkunde und Satzung, der OGAW-Vorschriften und der OGAW-Vorschriften der Zentralbank verwaltet worden.

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

Datum: 17. April 2024

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

Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds Plc (die „Gesellschaft") für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr geprüft, der aus den Bilanzen, den Gewinn- und Verlustrechnungen, den Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens und den Anmerkungen zum Jahresabschluss besteht, einschließlich der in Anmerkung 1 beschriebenen Zusammenfassung der Bilanzierungsgrundsätze. Der bei der Aufstellung angewandte Rahmen für die Finanzberichterstattung umfasst irisches Recht und FRS 102, den im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendenden Rechnungslegungsstandard, herausgegeben im Vereinigten Königreich vom Financial Reporting Council.

Unserer Meinung nach:

- vermittelt der Jahresabschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild von den Aktiva und Passiva und von der Geschäftslage des Fonds zum 31. Dezember 2023 und seinem Verlust für das dann beendete Geschäftsjahr;
- wurde dieser Jahresabschluss ordnungsgemäß im Einklang mit FRS 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland" erstellt; und
- wurde dieser Jahresabschluss ordnungsgemäß in Einklang mit den Vorschriften des Companies Act von 2014, den Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren betreffend) von 2011 und den Central Bank (Supervision and Enforcement Act) 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations von 2019 erstellt.

Grundlage für das Testat

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

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

Feststellungen zur Unternehmensfortführung

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

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

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

Sonstige Informationen

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

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

Sonstige Informationen (Fortsetzung)

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

Wir haben diesbezüglich keine Angaben zu machen.

Vom Companies Act von 2014 vorgeschriebene Stellungnahmen zu sonstigen Sachverhalten

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

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

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

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

Angelegenheiten, über die wir im Ausnahmefall berichten müssen

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

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

Jeweilige Aufgaben

Aufgaben der Direktoren im Hinblick auf den Jahresabschluss

Wie in der Beschreibung der Aufgaben der Direktoren auf Seite 35 ausführlicher erläutert, sind die Direktoren zuständig für die Aufstellung des Abschlusses gemäß dem geltenden Rahmen für die Finanzberichterstattung, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt, und die von ihnen als notwendig erachteten internen Kontrollen, um eine Aufstellung des Jahresabschlusses ohne wesentliche Falschdarstellungen aufgrund von Betrug oder Irrtum zu ermöglichen.

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

Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung

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

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

http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf.

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Berichts des Wirtschaftsprüfers.

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

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

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

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

Dublin

Datum: 22. April 2024

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

Die Direktoren
Neuberger Berman Investment Funds plc

Prüfvermerk

Wir haben den Jahresabschluss der Neuberger Berman Investment Funds Plc (der „Fonds") geprüft, der aus der Bilanz zum 31. Dezember 2023, der Gewinn- und Verlustrechnung, der Aufstellung über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens für das dann beendete Geschäftsjahr und den Anmerkungen zum Jahresabschluss besteht.

Nach unserer Meinung stellt der Jahresabschluss in allen wesentlichen Aspekten die Bilanzen des Fonds zum 31. Dezember 2023 und seine Betriebsergebnisse sowie die Veränderungen des Nettovermögens gemäß den Bilanzierungsgrundsätzen, einschließlich FRS 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland" (in Irland allgemein anerkannte Bilanzierungsgrundsätze – irische GAAP), angemessen dar.

Grundlage für das Testat

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

Aufgaben des Managements im Hinblick auf den Jahresabschluss

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

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

Aufgaben des Wirtschaftsprüfers im Hinblick auf die Abschlussprüfung

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

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

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

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

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

Sonstige Informationen

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

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

Ernst & Young
Dublin, Irland
22. April 2024

5G Connectivity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 39,43 %. Der als Benchmark dienende MSCI All-Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 22,20 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das langsamere Zinserhöhungstempo der US-Notenbank (im Folgenden auch die Federal Reserve oder Fed) führte zu einer allgemeinen Outperformance von Technologie und Wachstumswerten
- Die mit der Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft nach Covid verbundenen Hoffnungen zu Beginn des Jahres schwanden, und die Stimmung verschlechterte sich angesichts einer unerwartet langsamen Erholung und begrenzter Konjunkturmaßnahmen
- Angesichts der makroökonomischen Unsicherheit, einschließlich einer Regionalbankenkrise in den USA und anhaltender weltweiter geopolitischer Spannungen waren die Märkte volatil
- Megacap-Wachstumsaktien mit einer hohen Marktkapitalisierung dominierten, und das Aufkommen von KI als Anlagethema führte zu einer Rally bei diesen Titeln

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung von Halbleitern und Software gegenüber dem Index.
  - Die Einzeltitelauswahl in den Bereichen Technologie-Hardware und -peripherie und Gesundheitswesen.
  - KI-Gewinner unter besonders leistungsstarken Anbietern von Halbleitern, Hardware und Hochgeschwindigkeitsnetzen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Engagement in China.
  - Die Einzeltitelauswahl in den Bereichen interaktive Medien und Dienstleistungen sowie Nicht-Basiskonsumgüter.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das erhöhte Engagement im Halbleitersegment, aufgrund eines steigenden strategischen Werts und da die Talsohle der Zyklizität erreicht war.
- Das erhöhte Engagement unter Softwaretiteln aufgrund von Trends in der Unternehmensdigitalisierung.
- Das erhöhte Engagement bei Mega-Caps und ein reduziertes Engagement bei SMID-Caps angesichts der makroökonomischen Unsicherheiten.
- Die Reduzierung des Engagements in China und eine Umschichtung in Richtung Taiwan und Japan.

Während das Ende des Zinserhöhungszyklus in Sicht ist, könnte die makroökonomische Unsicherheit anhalten. Wir setzen daher weiterhin auf Qualität, sind aber für ein zyklisches Wachstum positioniert. Es herrscht nach wie vor Volatilität, sodass unser Fokus weiterhin auf Qualität und Bereichen mit einem starken Rückenwind für die Erträge bzw. einer starken vorhersehbaren Ertragsentwicklung liegt. Dabei achten wir auf unsere Bewertungsdisziplin. Das 5G-Thema wird stärker, da es zu einer nationalen Priorität wurde und die Digitalisierung der Wirtschaft unaufhörlich voranschreitet. Was die Nutznießer des beschleunigten Hochlaufs von KI und 5G, eine strategische Halbleiterindustrie, und die Verbreitung der Industrieautomatisierung und erneuerbare Energien angeht, sind wir positiv gestimmt.

China A-Share Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse CNY I -12,31 %. Der als Benchmark dienende MSCI China A Onshore Net Index (Total Return, CNY) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum -9,87 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt für chinesische A-Aktien hat 2023 nachgegeben. Die Erwartungen auf eine Rückkehr zu schnellem Wachstum im Anschluss an die Pandemie, die zu Beginn des Jahres noch für eine Erholung gesorgt hat, wurden durch das laue Wachstum in China, ausbleibende Stimulierungsmaßnahmen seitens der Zentralregierung und die Turbulenzen auf dem chinesischen Immobilienmarkt enttäuscht.
- Die Aktivität im verarbeitenden Gewerbe nahm zu Beginn des Jahres zu, aber die PMI-Werte für das verarbeitende Gewerbe kamen im weiteren Verlauf des Jahres nicht über die Expansionsschwelle von 50 hinaus. Die staatlichen Anreize und die wirtschaftliche Unterstützung gegen Ende des Jahres änderten nur wenig an der Stimmung der Anleger, da die Konsensusmeinung vorherrschte, dass die Maßnahmen unzureichend seien.
- Energie, Kommunikationsdienste und Versorger waren die einzigen Sektoren mit Gewinnen im Jahresverlauf, während die Sektoren Immobilien, Industrie und Werkstoffe am stärksten zurückgingen.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Gesundheitswesen und Werkstoffe leistete den größten Beitrag zu den relativen Erträgen für das Jahr. Gleiches gilt für eine Untergewichtung von Werkstoffen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Underperformance des Portfolios für das gesamte Jahr ging in erster Linie auf das erste Quartal zurück, als unsere Anlagedisziplin dazu geführt hat, dass wir in Sektoren wie KI unterrepräsentiert waren. Für den Rest des Jahres lag das Portfolio entweder auf einer Linie mit dem Index oder verzeichnete Outperformance.
  - Die Einzeltitelauswahl in den Bereichen Finanzen und IT sowie eine Nullallokation in Energie schadeten der Wertentwicklung am meisten.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb auf Binnenwachstum fokussiert durch hochwertige Unternehmen aus dem gesamten Marktkapitalisierungsspektrum.
- Wir konzentrierten uns weiterhin auf Unternehmen, die wir als „Quality Compounders" ansehen – Aktien mit beständigen, verlässlichen hohen Eigenkapitalrenditen (ROE) aus den Bereichen Konsumgüter und Gesundheitswesen, die sich durch ein langfristiges Potenzial auszeichnen – sowie „Secular Growth Beneficiaries", also Unternehmen, die für inländisches Wachstum positioniert sind und von langfristigen Trends und politischer Unterstützung profitieren, z. B. in der modernen Fertigung.
- Wir haben Fortschritte mit unserem hausinternen ESG-Research und ESG-Engagement gemacht und nutzen Treffen mit dem Management, um Änderungen vorzuschlagen, von denen wir längerfristige Vorteile erwarten.

Mit Blick auf die Zukunft sind wir der Ansicht, dass sich die chinesische Wirtschaft wandelt. Der Immobiliensektor gerät in den Hintergrund und die Anleger werden sich erneut auf das Potenzial für nachhaltige langfristige Renditen konzentrieren. Für das Portfolio stehen weiterhin einzelne Unternehmen mit soliden Fundamentaldaten und attraktiven Bewertungen im Mittelpunkt. Derzeit sehen wir Chancen bei Unternehmen mit hohen Dividendenausschüttungen, Unternehmen mit einem geschäftlichen Schwerpunkt auf Verbraucher im unteren und mittleren Bereich sowie bei medizinischen Dienstleistungen und Biopharma sowie Fertigungstechnologie.

China Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Ausschüttenden Klasse CNY I 3,39 %. Der als Referenzindex dienende FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select Index (CNY Total Return (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 2,21 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die chinesische Wirtschaft hatte 2023, nach der Erholung im Anschluss an die Pandemie, einen konstruktiven Start. Der Optimismus über die Wiedereröffnung der Wirtschaft sollte jedoch bald schwinden. Im zweiten Quartal 2023 trübten sich die Wirtschaftsaussichten Chinas aufgrund des Gegenwinds aus dem Immobiliensektor, der schwächeren Nachfrage aus dem Ausland und des schwachen Binnenkonsums deutlich.
- Das nachlassende Wachstum wurde von den geldpolitischen Entscheidungsträgern zur Kenntnis genommen und führte zu einem Strategiewechsel in der zweiten Jahreshälfte. Die chinesische Regierung leitete verschiedene Maßnahmen zur Ankurbelung der Wirtschaft ein, u. a. zwei Senkungen des Zinssatzes für die mittelfristige Kreditfazilität durch die Europäische Zentralbank und eine große Emission von Staatsanleihen (Central Government Bonds, „ CGB") im Wert von 1 Billion RMB durch den Ständigen Ausschuss des NVK. Darüber hinaus wurden zusätzliche Maßnahmen zur Ankurbelung der Nachfrage auf dem Wohnungsmarkt und zur Beschleunigung der Ausgabe spezieller Kommunalobligationen eingeführt.
- Vor diesem makroökonomischen Hintergrund verzeichneten chinesische Staatsanleihen eine respektable Erholung, und die Anleiherenditen beendeten das Jahr nahe der Talsohlen des bisherigen Jahres. Dieser Trend spiegelte sich auch an den Onshore-Kreditmärkten wider, wobei sich die Kreditspreads deutlich verringerten.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Onshore-Unternehmensanleihen lieferten positive Beiträge, da Zinsen und Kreditspreads querbeet kräftig anstiegen.
  - Offshore-Unternehmensanleihen leisteten aufgrund des vorteilhaften Renditegefälles ebenfalls Positivbeiträge.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Zu den größten Verlustbringern zählten angesichts der beträchtlichen Abflüsse und der schlechten Anlegerstimmung unsere Onshore-Wandelanleihen.
  - Die größten Wertabzüge entfielen unter anderem auf unsere USD-Immobilienpositionen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben die Duration im Laufe des Jahres schrittweise erhöht, vor allem bei den Zinsen. Die Rally bei den Onshore-Kreditspreads im bisherigen Jahresverlauf hat uns allerdings veranlasst, aus Bewertungssicht eine vorsichtigere Position zu beziehen.
- Abgesehen von den knappen Onshore-Kreditspreads blieb das Zinsgefälle zwischen CNY und USD erheblich, woraus sich ein attraktives relatives Wertangebot chinesischer USD-Unternehmensanleihen ergab.

Wir sind uns bewusst, dass es der chinesischen Wirtschaft aufgrund struktureller Verlagerungen im Inland noch immer an Dynamik mangelt. Zum gegenwärtigen Zeitpunkt denken wir, dass fiskalische Maßnahmen der wichtigste Katalysator für die Wiederbelebung der nachlassenden Konjunktur sind, um die Nachfrage zu stimulieren und die Preise zu stützen. Unserer Ansicht nach ist es zwingend notwendig, dass solche fiskalischen Anstrengungen durch eine entgegenkommende Geldpolitik ergänzt werden. Wir rechnen daher mit der Möglichkeit einer weiteren geldpolitischen Lockerung im kommenden Jahr. Mit dem nun angelaufenen Schuldenumwandlungsprogramm für Kommunen zeichnet sich eine Erleichterung der fiskalischen Belastung Letzterer und eine Verbesserung der Liquiditätsbedingungen für chinesische lokale Finanzierungsplattformen (Local Government Financing Vehicles, „LGFVs") ab.

China Equity – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -22,22 %. Der als Benchmark dienende MSCI China All Shares Net Total Return Index (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Minus von 11,53 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- 2023 war ein schwieriges Jahr für börsennotierte Offshore- und Onshore-Aktien, da die Wiedereröffnung der Wirtschaft nicht, wie vom Markt erwartet, eine starke zyklische Erholung mit sich gebracht hatte. Während sich der Inlandsreiseverkehr, die Ausgaben im Gaststättengewerbe und die Infrastrukturinvestitionen seit Anfang des Jahres verbessert haben, blieb der Wohnungsmarkt ebenso schwach wie die privaten Investitionen.
- Außerdem hielten sich die Bedenken hinsichtlich der geopolitischen Lage, der Risiken für lokalen Finanzierungsplattformen (LGFV) und des Fehlens umfassender geldpolitischer Anreize an. Die Märkte bevorzugten daher eindeutig defensive, renditestarke Sektoren wie Telekommunikation, Energie und Versorger, während andere Sektoren trotz sich verbessernder Fundamentaldaten Underperformance verzeichneten.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Zur Performance des Portfolios trugen vor allem das Gesundheitswesen (Einzeltitelauswahl in der Biotechnologie) und der Immobiliensektor (Einzeltitelauswahl) bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Performance wurde vor allem durch folgende Sektoren beeinträchtigt: Werkstoffe (Einzeltitelauswahl bei Chemikalien), Nicht-Basiskonsumgüter (Einzeltitelauswahl bei Einzelhändlern ohne Spezialisierung und Textilien/Bekleidung/Luxusgüter) und Finanzwerte (erhebliche Untergewichtung und Einzeltitelauswahl bei Banken).

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im vergangenen Jahr stieg das Engagement des Portfolios im IT-Sektor am stärksten, und zwar von 6,36 % auf 11,60 %. Auf IT folgte der Sektor Nicht-Basiskonsumgüter, der von 23,89 % auf 25,86 % anstieg.
- Das Portfolioengagement in Werkstoffen ging unterdessen von 19,94 % auf 15,72 % zurück, gefolgt von Basiskonsumgütern, bei denen das Engagement von 10,63 % auf 7,59 % fiel.

Mit Blick auf die Zukunft bleibt unsere Sichtweise hinsichtlich der Anlagegelegenheiten konstruktiv, da sich die Regierung darauf konzentriert, hochwertiges Wachstum zu fördern und das Anlegervertrauen zu stärken. Unserer Meinung nach werden die jüngsten geldpolitischen Lockerungsmaßnahmen, zu denen auch finanzpolitische Impulse in Höhe von 1 Bio. Yuan und die Unterstützung des angeschlagenen Immobiliensektors gehören, wahrscheinlich allmählich in das System einfließen und eine breit angelegte wirtschaftliche Erholung unterstützen. Wichtiger ist noch, dass wir davon ausgehen, dass die Unternehmensgewinne die Talsohle erreichen und mit der Normalisierung der Wirtschaft im Jahr 2024 allmählich wieder attraktiv werden. Für die Kernpositionen gilt über das gesamte Portfolio hinweg, dass sich die meisten trotz der wirtschaftlichen Schwierigkeiten erfolgreich weitere Marktanteile sichern konnten. Sie sind dadurch nun besser aufgestellt, um von einer potenziellen Erholung zu profitieren, die wir für 2024 erwarten. Abschließend ist festzustellen, dass die Bewertungen nach wie vor sehr attraktiv sind. Das KGV des MSCI China All Shares Index und des CSI 300 Index beträgt 9,8x beziehungsweise 10,4x gegenüber 17,4x beziehungsweise 19,5x für den MSCI World Index und den S&P 500 Index.

Climate Innovation – Bericht des Investment-Managers

Von ihrer Auflage am 1. August 2023 bis zum Ende des Berichtszeitraums am 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der thesaurierenden Klasse USD I -3,00 %. Der als Benchmark dienende MSCI All-Country World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 3,98 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Anschluss an die Auflegung des Portfolios zeigten sich die globalen Aktienmärkte volatil, da die Gewinne für das zweite Quartal gemischt ausfielen und geopolitische Instabilität sowie wirtschaftliche Unsicherheiten den Ton angaben. Die US-Notenbank deutete zudem an, dass die Zinssätze noch länger hoch bleiben würden, was die Rendite der 10-jährigen US-Staatsanleihen auf ein neues 15-Jahres-Hoch trieb. Während der Druck auf die Kerninflation gering war, stiegen die Ölpreise weiter stark an, und die Trends bei den Verbraucherausgaben zeichneten ein uneinheitliches Bild.
- Die globalen Aktienmärkte erholten sich dann zum Jahresende, da die Fed nach einem raschen Zinsrückgang und ihrer Abkehr vom Slogan „höher für länger" im Fahrwasser von günstigeren Inflationsdaten eine freundlichere Haltung einnahm. Da sich der Markt auf mögliche Zinssenkungen ab März 2024 einstellt, näherte sich der S&P 500 einem neuen Allzeithoch, während die Rendite auf die 10-jährige US-Staatsanleihen den stärksten zweimonatigen Rückgang seit 2008 verzeichnete.
- Während des Berichtszeitraums erwies sich, dass das globale Wachstum nicht synchronisiert ist: Die Vereinigten Staaten verbuchten eine im Kontext der Markterwartungen überdurchschnittlich gute und China eine unterdurchschnittliche Entwicklung.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Übergewichtung von Industriewerten gegenüber dem Index.
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Versorger und Industrie.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtung der Sektoren Finanzwerte, Energie und Kommunikationsdienste gegenüber dem Index.
  - Die Übergewichtung der Solarindustrie gegenüber dem Index.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Beteiligungen in der Solarbranche waren über die Bereiche Solarenergie für Privathaushalte und Solarenergie für Versorgungsunternehmen (einschließlich Installateure) diversifiziert.
- Das Engagement im Batteriesegment wurde aufgrund des sich abschwächenden Narrativs im dritten Quartal auf die Märkte für Elektrofahrzeuge in den USA und der EU reduziert.

Mit Blick auf die Zukunft sind wir der Meinung, dass das makroökonomische Umfeld unbeständig bleiben könnte, weil die Zentralbanken versuchen, die Inflation wieder auf das angestrebte Niveau zu bringen und gleichzeitig das Wirtschaftswachstum zu stützen. Dies wiederum hat Auswirkungen auf die Zinssätze. Insgesamt werden wir wahrscheinlich eine Übergewichtung von Industriewerten beibehalten, um unsere Ansicht über die langfristigen strukturellen Wachstumschancen in diesem Sektor widerzuspiegeln. Bei den erneuerbaren Energien bleiben wir bei unserer Untergewichtung, da sich die Fundamentaldaten erst noch ändern müssen, und im Bereich der EV/EV-Batterien werden wir wohl weiter selektiv vorgehen, während wir die Nachfrage und die regulatorischen Bedingungen beobachten, um zu beurteilen, wann wir uns in diesem Bereich umfassender engagieren können.

CLO Income – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 21,72 %. Der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (der Index) rentierte im selben Zeitraum 5,12 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Nachdem die Kreditspreads für Collateralised Loan Obligations (CLO) von höherer Qualität mit BB-Rating das Jahr 2022 im Kontext der Secured Overnight Financing Rate (SOFR)+850 abgeschlossen hatten, verengten sich die Spreads im Januar, als nachlassende Rezessionssorgen und nachgebende Inflationsindikatoren bei den Spreads für BB-CLO höherer Qualität zu einer Verengung auf fast+775 geführt hatten. Das sorgte auf dem CLO-Primärmarkt für zusätzliche Dynamik, da CLO-Manager versuchten, aus knapperen CLO-Spreads Kapital zu schlagen.
- Diese Verengung der Kreditspreads kehrte sich im Februar und März rasch wieder um, da unerwartete Wirtschaftsdaten die Spekulationen der Anleger um mögliche weitere – und vielleicht beschleunigte – Zinserhöhungen anheizten. Noch verstärkt wurden diese Sorgen im März durch Pleiten von Regionalbanken und Bedenken, die die Spreads von CLO mit BB-Rating Mitte März in den SOFR-Bereich von+900 trieben, bevor bessere Stimmung infolge von Zusicherungen der US-Regierung, den Bankensektor zu stabilisieren, Ende März und Anfang April zu einer deutlichen Verengung der Spreads führte. Diese stabilisierten sich den Mai hindurch für CLO mit BB-Rating generell im Bereich von SOFR+800 bis +825.
- Von Juni bis in den September hinein verengten sich die Spreads von CLO aus dem BB-Segment, da verschiedene Wirtschaftsdaten weiterhin auf langsamere Zinserhöhungen hinwiesen. Auch die Kredite verteuerten sich in diesem Zeitraum aufgrund der verbesserten Stimmung um etwa 2,5 Punkte und erreichten damit neue Jahreshöchststände im Kredithandel. Ende September lagen die Kreditspreads für CLOs mit BB-Rating auf dem Sekundärmarkt im Kontext von SOFR+745.
- Im vierten Quartal des Kalenderjahres verengten sich die CLO-Spreads deutlich, da die Wirtschaftsdaten und die Stellungnahmen der US-Notenbank auf eine geringere Wahrscheinlichkeit für künftige Zinserhöhungen hindeuteten und der Markt sich zunehmend auf eine „weiche Landung" einstellte. Zum Jahresende lagen die Spreads für CLO mit BB-Rating auf dem Sekundärmarkt im SOFR-Bereich von +675.
- Zum 31. Dezember 2023 betrug ihre nennwertgewichtete Ausfallquote für die vorhergehenden zwölf Monate 1,53 % und damit 264 Basispunkte weniger als der Höchststand bei 4,17 % von September 2020. Das Volumen der Neuemissionen ging gegenüber dem Niveau von 2022 um 24 % zurück. Trotz eines schwierigeren Umfelds für Aktienarbitrage war der CLO-Primärmarkt weiterhin aktiv, da die Manager die im Vergleich zum Vorjahr engeren Kreditspreads für CLO ausnutzten.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl auf dem Markt für die auf USD lautende Mezzanine-Tranche des CLO-Marktes und Allokation zu auf Euro lautende CLO mit B-Rating
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Allokation auf den USD-Hochzinsmarkt.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Während wir unser Engagement in europäischen CLOs im Berichtszeitraum nach und nach aufgestockt haben, ist das Portfolio nach wie vor überwiegend in US-Krediten engagiert: 71 % der CLO-Positionen lauten auf US-Dollar.
- Im Juni nutzten wir die Rally bei CLO, um unser Engagement in CLO zurückzufahren, deren Emission bereits länger zurücklag.

Trotz makroökonomischer und geopolitischer Bedenken vertrauen wir grundsätzlich weiterhin auf die beträchtliche strukturelle Absicherung, die gegen Kreditverluste in den zugrunde liegenden Kreditportfolios besteht. CLO-Strukturen im Allgemeinen und CLO-Schuldtitel mit BB-Rating im Besonderen haben sich angesichts einer erheblichen Rezession im Jahr 2020 einmal mehr als sehr robust erwiesen. Wir sind der Meinung, dass unser Fokus auf Anlagen in erstklassigen zugrunde liegenden Kredite zu einer Outperformance gegenüber dem allgemeinen CLO-Markt führen wird.

Commodities – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -6,52 %. Im selben Zeitraum betrug die Rendite des Bloomberg Commodity Index (der Index) -7,91 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Nach einem schwierigen Jahr 2022 erzielten globale Aktien und Anleihen im Jahr 2023 eine starke Performance und trotzten damit den Erwartungen der meisten Anleger, die erwartet hatten, dass der globale Straffungszyklus die Wirtschaftstätigkeit belasten würde.
- Der Inflationsdruck ließ im Jahresverlauf nach, und die Zentralbanken gingen von einer aggressiven Rhetorik zu einer datenabhängigen Haltung über und stellten zum Jahresende die Weichen für Zinssenkungen im Jahr 2024. Während die Anleger durch ein unbeständiges, von regionalem Bankenstress und geopolitischen Spannungen geprägten Wirtschafts- und Investitionsmfeld navigierten, blieben die Unternehmensgewinne dank eines gut gestützten Verbraucher- und Arbeitsmarktes stabil.
- Der S&P 500 Index und der Bloomberg US Aggregate Bond Index stiegen beide im Laufe des Jahres an und erzielten eine Rendite von 26,29 % bzw. 5,53 %. Rohstoffe blieben im Jahr 2023 zurück, und der Index sank im Jahresverlauf um -7,91 %.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Positionierung im Energiesektor und eine starke Untergewichtung von Erdgas trugen am meisten zur Outperformance bei und halfen dem Portfolio, den Rückgang bei Erdgastiteln während des Berichtszeitraums zu vermeiden.
  - Agrarstoffe waren die Rohstoffe mit der besten Performance, wobei Kakao, Zucker und Kaffee die drei wichtigsten Rohstoffe darstellten. Das Portfolio verzeichnete eine Outperformance aufgrund von Gewinnen aus einer Kakao-Position von außerhalb der Benchmark.
  - Der Nutztiersektor trug aufgrund einer Übergewichtung in Lebendrindern, einer Position von außerhalb der Benchmark in Mastrindern und einer untergewichteten Position in magerem Schweinefleisch zur Outperformance des Portfolios gegenüber dem Index bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Energie und Industriemetalle waren die Sektoren mit der schlechtesten Wertentwicklung.
  - Die Übergewichtungen in Zink und Blei wirkten sich negativ aus.
  - Die Positionierung in Edelmetallen wurde durch eine Untergewichtung im Goldsegment und eine Position in Palladium von außerhalb der Benchmark beeinträchtigt.
  - Die Positionierung in der Landwirtschaft war leicht nachteilig. Das Portfolio profitierte zwar von einer Untergewichtung in Sojabohnen und Weizen, doch wurde dies durch die Übergewichtung in Mais und Kansas-Weizen wieder wettgemacht.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

Mit Blick auf 2024 werden mehrere wichtige Faktoren die Rohstofflandschaft prägen: Die erwarteten Zinssenkungen, eine Abschwächung des Dollars sowie die strategischen Produktionsanpassungen der OPEC+ werden die Rohstoffpreise durch die Reihe stützen. Insbesondere Energierohstoffe bieten attraktive Anlagegelegenheiten, da die aktuellen Kurse die zugrundeliegende Angebotsknappheit möglicherweise nicht vollständig widerspiegeln. Im Metallsektor sind Kupfer und Aluminium gut positioniert, um von der Beschleunigung der Energiewende zu profitieren. Ihre kritische Rolle für die grüne Technologie und Infrastruktur verspricht inmitten dieses globalen Wandels eine robuste Performance. Gold, traditionell ein sicherer Hafen, wird voraussichtlich von einem Rückgang der Realzinsen profitieren, wobei die geopolitischen Unsicherheiten zusätzliche Unterstützung bieten. Die Agrarmärkte stehen vor einem potenziellen Wendepunkt, da die drohende Gefahr eines starken El Niño die Ernteproduktion gefährden könnte, was wiederum das Schicksal der weltweiten Versorgung mit den geopolitischen Verwicklungen um den Getreidekorridor im Schwarzen Meer verknüpft. Letztlich sei noch erwähnt, dass in einem Jahr, in dem traditionelle Märkte während euphorischer Aufschwünge den Höhepunkt der „Angst, etwas zu verpassen" (Fear of missing out, „FOMO") erleben könnten, sich inflationsempfindliche Rohstoffe als eine umsichtige Absicherung gegen potenzielle wirtschaftliche Schlaglöcher anbieten. Wir gehen von einer Reihe komplexer Anlagegelegenheiten aus, wobei die strategische Positionierung in 2024 der Schlüssel zur Navigation durch das Marktumfeld ist.

Corporate Hybrid Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 8,14 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5 % Constrained Custom Index (Total Return, Hedged, Euro) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 9,25 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Märkte für hybride Anleihen lieferten starke Renditen und trotzten der Volatilität, da die Fundamentaldaten intakt blieben.
- Wichtig ist, dass die Emittenten ihre Anleihen weiterhin kündigten, was hinsichtlich des idiosynkratischen Risikos in diesem Bereich der wichtigste Faktor ist. Im Jahr 2023 haben sich Unternehmen wie Ferrovial und Balder, bei denen eine Verlängerung der Kündigungsfrist für ihre wirtschaftliche Planung Sinn machte, dennoch für eine Kündigung zum ersten Kündigungstermin entschieden. Das Segment wächst weiterhin schnell, wobei sich die Diversifizierungsmöglichkeiten sowohl auf sektoraler als auch auf geografischer Ebene verbessern.
- Neuemissionen waren unserer Ansicht nach aufgrund von ESG-Bedenken weniger attraktiv.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl leistete im Verlauf des Jahres mit einer Outperformance von 121 Basispunkten (Bp) gegenüber dem Index den größten Wertbeitrag. Die Auswahl von Versorgern trug in diesem Zusammenhang relativ gesehen 91 Bp bei, während sowohl Telekommunikation (37 Bp) als auch das Gesundheitswesen (31 Bp) ebenfalls einen wichtigen Wertbeitrag leisteten.
  - Versorger, unsere größte Übergewichtung (ca. 11 %) und größte absolute Position (ca. 50 %), haben durchweg eine starke relative Performance für das Portfolio erzielt und trugen insgesamt mit 88 Bp am meisten zur Rendite bei, wobei Namen wie National Grid, EDF und Veolia Outperformance verbuchten.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Vermögensallokation beeinträchtigte die relative Performance mit -76 Bp am stärksten, was primär eine Folge unserer Übergewichtung von rund 6 % an Barmitteln im Portfolio war. Unsere Allokation zu Barmitteln bietet wichtige Liquidität, die es den Portfoliomanagern erlaubt, das Portfolio als Reaktion auf sich ändernde Marktbedingungen schnell zu steuern. Es handelt sich hierbei weiterhin um eine taktische Entscheidung.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Auf Sektorebene waren unsere größten Übergewichtungen im Jahr 2023 Versorger (ca. 11 %) und Telekommunikation (ca. 4 %). Diese Sektoren werden in unseren Augen weiterhin unter dem beizulegenden Zeitwert gehandelt. Wir haben Energie (ca. -13 %), den zweitgrößten Sektor im Index, weiterhin untergewichtet, da wir hier eine gewisse Disparität sehen und qualitativ hochwertigere Namen bevorzugen.
- Unsere Entscheidungen zu Anleihekäufen erfolgten auf individueller Basis nach Bewertungen, die im Zusammenhang mit einem insgesamt niedrigen Geschäftsrisiko, geringen Schwankungen der Gewinne vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen (EBITDA) und einem vorteilhaften regulatorischen Umfeld beurteilt wurden.
- Insgesamt waren (und sind) wir bei defensiven, qualitativ hochwertigen, hochverzinsten Kupon-Unternehmensanleihen mit Eintrittsbarrieren und Unterstützung durch Interessengruppen konsistent positioniert.

Wir sind der Ansicht, dass sich die Kombination aus hohen Renditen, einer größeren Zahl an Anlagegelegenheiten durch Neuemissionen und dem Potenzial für Spread-Verengungen mit der Zeit positiv auf das Portfolio auswirken werden.

Developed Market FMP – 2027 – Bericht des Investment-Managers

Für den Berichtszeitraum von seiner Auflegung am 31. Juli 2023 bis zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,00 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve und die Europäische Zentralbank hoben die Leitzinsen um 100 Bp bzw. 200 Bp an.
- Die Zinsvolatilität war das ganze Jahr über hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies startete eine erhebliche Rally bei Staatsanleihen und Risikoanlagen.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für globale Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade verengten sich um 32 Bp bzw. 122 Bp.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Die Engagements des Portfolios in Investment-Grade- und Hochzins-Unternehmensanleihen lieferten eine breit angelegte Performance.
  - Innerhalb des Investment-Grade-Bereichs leisteten die Beteiligungen in den Bereichen Banken und Kommunikation die größten Wertbeiträge.
  - Bei den Hochzinsanleihen lagen die Engagements in Nicht-Basiskonsumgütern und Energie an der Spitze der Beitragsleister.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Aus Sektorperspektive gab es keine wesentlichen Negativbeiträge.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio wurde im Juli 2023 aufgelegt.
- Das Portfolio war in verschiedenen Unternehmensbranchen, Ratingkategorien und Industrieländern investiert.
- Am Ende des Berichtszeitraums war das Portfolio zu ungefähr 80 % mit Investment Grade bewertet und zu 20 % in Positionen ohne Investment Grade investiert.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zweiteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

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

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 13,87 %. Der als Benchmark dienende JPM EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 11,09 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Mit einer erheblichen Volatilität während des Jahres begann und endete es für Schwellenländer (EM) auf einer positiven Note, die auf der Erwartung beruhte, dass eine weiche Landung und eine ernsthafte geldpolitische Lockerung in den USA der Anlageklasse durch niedrigere Kreditkosten zugute kommen würde. Das Thema gewann im Dezember weiter an Dynamik, insbesondere nachdem die Federal Reserve eine Zinssenkung um 75 Bp für 2024 angekündigt hatte.
- Der Zusammenbruch der Silicon Valley Bank im März führte zu einigen der seit Jahrzehnten größten Bewegungen am Rentenmarkt. Ab dem Sommer führte dann die Aussicht auf für einen längeren Zeitraum höhere Zinsen zu einem großen Ausverkauf bei Anleihen, der die Renditen auf 10-jährige US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit der globalen Finanzkrise kurzzeitig über 5 % klettern ließ.
- Die geopolitischen Ereignisse blieben ebenfalls im Fokus, insbesondere nach dem Angriff der Hamas auf Israel im Oktober, während es unterdessen keine Lösung für den Krieg in der Ukraine gab.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Länderallokation zeichnet sich durch die Übergewichtung von Märkten mit höheren Renditen, insbesondere El Salvador, Argentinien und Sri Lanka aus.
  - Eine Untergewichtung von niedrig verzinsten Anleihen mit Investment Grade (IG).
  - Einzeltitelauswahl über auf Euro lautende Anleihen aus Kasachstan und der Elfenbeinküste.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Eine Untergewichtung von Pakistan und der Türkei, die durch die Unterstützung des Internationalen Währungsfonds bzw. einer Hinwendung zu einer orthodoxen Politik begünstigt wurden.
  - Eine übergewichtete Allokation zu Ecuador, wo politische Herausforderungen den Druck auf die Finanzen verstärkten.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio hielt an einer Tendenz zu Hochzinstiteln (gegenüber IG-Unternehmensanleihen) fest. Wir erhöhten unsere Übergewichtung von Argentinien in Erwartung positiver politischer Anpassungen nach den Wahlen sowie ebenso in Kolumbien, El Salvador, der Elfenbeinküste und Serbien, wo wir Widerstandsfähigkeit gegenüber den strengeren globalen Finanzierungsbedingungen feststellen.
- Wir haben unsere Übergewichtung von Sambia erhöht, da wir davon ausgehen, dass der Restwert (Recovery Value) nach der Umstrukturierung höher ausfallen wird als die Marktpreise. Wir reduzierten unsere übergewichtete Allokation in Ecuador angesichts zunehmender politischer und finanzieller Risiken.
- Die Allokation zu auf Euro lautende Anleihen und Unternehmensanleihen betrug 18,8 % bzw. 13 %.

Wir gehen davon aus, dass die Anlageklasse der EM-Anleihen von einem Umfeld mit niedrigeren globalen Renditen und einem zunehmenden Wachstumsvorsprung für Schwellenländer gegenüber den Industrieländern im Jahr 2024 unterstützt werden wird. Wir sehen ein für dieses Jahr begrenztes Risiko für Ausfälle von Staatsanleihen, während das verstärkte Engagement des Internationalen Währungsfonds in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenda unterstützen dürfte. Die technischen Daten der Anlageklasse haben sich verbessert, da die Anleger nach einer Periode mit Rekordabflüssen hier nur noch geringfügig positioniert und die Zahl der Nettoemissionen begrenzt sind. Wir sehen Chancen für eine Verengung der Spreads bei bestimmten Emittenten und Anleihen von außerhalb der Benchmark, insbesondere im BB-Ratingsegment. Die Hauptrisiken für unsere konstruktive Sichtweise sind entweder eine unerwartete Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erfordern würde, oder eine tiefe globale Rezession, die die EM-Risikoprämien erheblich in die Höhe treiben würde.

Emerging Market Debt – Local Currency – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 13,88 %. Der als Benchmark dienende JPMorgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, Unhedged, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 12,70 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Insgesamt wurde die Marktstimmung von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Anzeichen für Höhepunkte bei den Zinserhöhungszyklen und nachlassende Inflation in verschiedenen Schwellenländern stützten die Renditen lokaler Anleihen.
- Die durchschnittlichen Indexrenditen sanken von 6,86 % auf 6,19 %, während die Währungen der Schwellenländer (EM) gegenüber dem US-Dollar im Durchschnitt um 2,4 % aufwerteten.
- Kolumbien war das Land mit der besten Performance im Index, gefolgt von Ungarn und Brasilien, während Ägypten und die Türkei mit Negativrenditen am schlechtesten abschnitten.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Positionierung in der Türkei, einschließlich einer Untergewichtung der türkischen Lira, verbunden mit einer Untergewichtung der nominalen Duration gegenüber einer Übergewichtung inflationsindexierter Anleihen.
  - Die übergewichtete Duration und Devisen in Kolumbien sowie Staatsanleihen in Argentinien.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Eine Untergewichtung der Zinspositionierung in Polen und Chile.
  - Außerhalb der Benchmark liegende Beteiligungen in Ghana und Israel.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben die übergewichtete Duration im Portfolio leicht erhöht, insbesondere was asiatische Märkten wie China und Indonesien angeht, wo wir Spielraum für weitere geldpolitische Stimuli sehen.
- Wir blieben bei unserer Übergewichtung der Duration in lokalen Märkten mit hohen Realzinsen in Lateinamerika und EMEA, darunter Brasilien, Mexiko, Kolumbien und Südafrika.
- Wir behielten eine moderate Übergewichtung des Währungsrisikos bei. Angesichts der teuren Bewertungen und des schwachen Wachstums wechselten wir bei der tschechischen Krone von einer Über- zu einer Untergewichtung. Bei der türkischen Lira bauten wir eine Übergewichtung auf, da wir bei dieser Währung im Anschluss an einen sehr aggressiven Erhöhungszyklus einen Wendepunkt sehen.

Wir gehen davon aus, dass die Anlageklasse der EM-Anleihen in 2024 von einem Umfeld mit einem langsameren, aber nicht rezessiven US-Wachstum, niedrigeren globaler Renditen und einem zunehmenden Wachstumsvorsprung für Schwellenländer gegenüber den Industrieländern unterstützt werden wird. Die relativ schwache Erholung in China, die Deflation und der strukturelle Gegenwind werfen weiterhin Fragen auf. Mit Unterstützung durch eine antizyklische Geld- und Fiskalpolitik rechnen wir für das Jahr 2024 mit einem Wachstum von 4,0 % bis 4,5 %. Es wird aber dennoch erwartet, dass das BIP-Wachstum der Schwellenländer insgesamt in diesem Jahr deutlich über dem der entwickelten Märkte liegen wird. Im Großen und Ganzen gehen wir weiterhin davon aus, dass die nachlassende Inflation in den meisten Schwellenländern ihren Lauf nehmen wird, was die Wertentwicklung lokaler Anleihen unterstützt. Die Währungen der Schwellenländer dürften von der Schwäche des US-Dollar profitieren, während sie außerhalb Asiens weiterhin von einem hohen Carry unterstützt werden. Die Hauptrisiken für unsere konstruktive Sichtweise sind entweder eine unerwartete Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die zu einer restriktiveren Haltung der Zentralbanken führen würde, oder das Entstehen einer tiefen globalen Rezession, die die EM-Risikoprämien erheblich in die Höhe treiben würde.

Emerging Market Debt Blend – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 12,28 %. Der als Benchmark dienende Index, eine gewichtete Mischung aus 50 % JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, nicht abgesichert, USD), 25 % JPMorgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) und 25 % JPMorgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 11,29 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Insgesamt wurde die Marktstimmung von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Anzeichen für Höhepunkte bei den Zinserhöhungszyklen und nachlassende Inflation in verschiedenen Schwellenländern stützten die Renditen lokaler Anleihen.
- Trotz der Herausforderungen, u. a. die Erwartung höherer Zinsen und schwächere Wirtschaftsdaten zu Jahresbeginn, erholten sich die globalen Märkte bis zum Jahresende aufgrund stabiler US-Zinsen und rückläufiger Inflationsindikatoren.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Eine Bottom-up-Positionierung in lokaler Währung bedingt durch eine übergewichtete Duration in Ungarn und Kolumbien. Die Long-Positionen in Devisen in Mexiko, Kolumbien und Uruguay und die Untergewichtung in der Türkei.
  - Die Bottom-up-Positionierung in Hartwährung aufgrund der Übergewichtung von Hochzins-Staatsanleihen, darunter El Salvador, Sri Lanka und Argentinien sowie aufgrund der Untergewichtung von Saudi-Arabien.
  - Die Top-down-Positionierung im Overlay aufgrund des Cash- und Devisen-Overlay war wertbeitragend.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Engagement bei der Zinsduration und die CDX-Position in den Overlay- und Hartwährungs-Segmenten.
  - Infolge der Positionen in China und Brasilien reduzierte sich die Bottom-up-Positionierung im Segment der Unternehmensanleihen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Da die Märkte weiterhin von Volatilität geprägt waren, konzentrierten wir uns auf die risikobereinigte Positionierung im Overlay-Segment.
- Im Bereich der Lokalwährungen haben wir die Übergewichtung der Duration im Portfolio leicht erhöht. Wir behielten im Berichtszeitraum eine moderate Übergewichtung des Währungsrisikos bei.
- Bei den Hartwährungen haben wir unsere Tendenz zu Hochzins-Staatsanleihen gegenüber Anleihen mit Investment Grade beibehalten.

Im Jahr 2024 werden Anleihen aus Schwellenländern (EM) wahrscheinlich durch ein bescheidenes US-Wachstum, niedrigere Renditen und eine bessere Entwicklung der Schwellenländer gegenüber den Industrieländern gestärkt werden. Obwohl die Erholung Chinas und die Deflation ein Anlass zur Sorge sind, erwarten wir ein BIP-Wachstum von 4,0 % bis 4,5 %, das durch eine proaktive Geld- und Fiskalpolitik unterstützt wird. Die Schwellenländer sollten die Industrieländer beim BIP-Wachstum überholen. Eine Desinflation könnte EM-Anleihen in Hartwährung begünstigen, während ein schwacher US-Dollar den EM-Währungen Auftrieb geben könnte, insbesondere im Fall eines hohen Carry außerhalb Asiens. Allerdings gehören zu den Risiken mögliche globale Inflationsschübe oder eine schwere Rezession, die die EM-Risikoprämien in die Höhe treiben.

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 8,32 %. Im selben Zeitraum verbuchte die zusammengesetzte Benchmark – ein Drittel der JPMorgan GBI Emerging Markets Global Diversified Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, nicht abgesichert, USD) und zwei Drittel der JPMorgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) (der Index) – ein Plus von 9,28 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Insgesamt wurde die Marktstimmung von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Anzeichen für Höhepunkte bei den Zinserhöhungszyklen und nachlassende Inflation in verschiedenen Schwellenländern stützten die Renditen lokaler Anleihen.
- Trotz der Herausforderungen, u. a. die Erwartung höherer Zinsen und schwächere Wirtschaftsdaten zu Jahresbeginn, erholten sich die globalen Märkte bis zum Jahresende aufgrund stabiler US-Zinsen und rückläufiger Inflationsindikatoren.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Eine Bottom-up-Positionierung in lokaler Währung bedingt durch eine übergewichtete Duration in Ungarn und Kolumbien. Ebenso positiv waren die Long-Positionen im mexikanischen Peso, kolumbianischen Peso und uruguayischen Peso.
  - Die Bottom-up-Positionierung in Hartwährungen war aufgrund der Übergewichtung in Rumänien, des Engagements außerhalb der Benchmark in Südkorea und der Nullgewichtung von Saudi-Arabien ebenfalls additiv.
  - Die Top-down-Positionierung im Overlay aufgrund der Barmittelposition war wertbeitragend.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Engagement bei der Zinsduration im Overlay und im Hartwährungs-Segment sorgte für Wertabzüge.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Da die Märkte weiterhin von Volatilität geprägt waren, konzentrierten wir uns auf die risikobereinigte Positionierung im Overlay-Segment.
- Bei den Lokalwährungen haben wir die Übergewichtung der Duration im Portfolio leicht erhöht. Wir behielten im Berichtszeitraum eine moderate Übergewichtung des Währungsrisikos bei.
- Im Bereich der Hartwährungen stockten wir das Engagement in Staatsanleihen mit starken Fundamentaldaten auf. Außerdem haben wir uns an den laufenden Emissionen von Investment-Grade-Titeln, die zu attraktiven Preisen angeboten wurden, beteiligt.

Im Jahr 2024 werden Anleihen aus Schwellenländern (EM) wahrscheinlich durch ein bescheidenes US-Wachstum, niedrigere Renditen und eine bessere Entwicklung der Schwellenländer gegenüber den Industrieländern gestärkt werden. Obwohl die Erholung Chinas und die Deflation ein Anlass zur Sorge sind, erwarten wir ein BIP-Wachstum von 4,0 % bis 4,5 %, das durch eine proaktive Geld- und Fiskalpolitik unterstützt wird. Die Schwellenländer sollten die Industrieländer beim BIP-Wachstum überholen. Eine Desinflation könnte EM-Anleihen in Hartwährung begünstigen, während ein schwacher US-Dollar den EM-Währungen Auftrieb geben könnte, insbesondere im Fall eines hohen Carry außerhalb Asiens. Allerdings gehören zu den Risiken mögliche globale Inflationsschübe oder eine schwere Rezession, die die EM-Risikoprämien in die Höhe treiben.

Emerging Markets Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 7,69 %. Der als Benchmark dienende MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 9,83 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Aktienwerte aus Schwellenländern (EM) legten im Jahr 2023 zu, insbesondere im vierten Quartal. Die Rally zum Jahresende war auf den Optimismus zurückzuführen, dass die US-Notenbank im Jahr 2024 mit Zinssenkungen beginnen könnte. EM-Aktien schnitten im Jahresverlauf allerdings aufgrund der Schwäche in China schlechter ab als internationale Aktien der Industrieländer (MSCI World) und US-Aktien (S&P 500).
- Innerhalb des Index erzielten IT, Energie und Finanzwerte eine überdurchschnittliche Wertentwicklung, während die Indexkomponenten mit einem erheblichen Engagement in China – Immobilien, Nicht-Basiskonsumgüter (einschließlich chinesischer Internetunternehmen) und Gesundheitswesen – an Wert einbüßten.
- Auf Länderbasis legten Ungarn und Griechenland mit Zuwächsen um die +50 % am meisten zu. China und Thailand verzeichneten die größten Verluste.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl und eine Übergewichtung des starken IT-Sektors sowie das Gesundheitswesen
  - Nach Ländern betrachtet, leisteten Aktien aus Taiwan, Saudi-Arabien und Indien die größten Wertbeiträge.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Portfolio blieb hinter dem Index zurück, was vor allem auf die Einzeltitelauswahl unter Nicht-Basiskonsumgütern und Finanzwerten zurückzuführen ist.
  - Nach Ländern ergaben sich die größten Wertabzüge durch Beteiligungen in China, gefolgt von denen in Mexiko und Korea.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Infolge der Bottom-up-Einzeltitelauswahl beschloss das Portfolio den Berichtszeitraum mit Übergewichtungen in den Sektoren IT, Basiskonsumgüter und Gesundheitswesen und Untergewichtungen in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter, Werkstoffe und Versorgung.
- Zu den größten Länderübergewichtungen zum Jahresende gehörten Allokationen von außerhalb der Benchmark in in den USA und im Vereinigten Königreich notierte Titel, eine Nische in wichtigen Schwellenländern sowie Indien. Die Aufstockungen in diesen Regionen wurden durch eine weitere Reduzierung der chinesischen Positionen finanziert, die zusammen mit Südafrika und Korea am meisten untergewichtet waren.

Aus makroökonomischer Sicht könnten im Jahr 2024 die Präsidentschaftswahlen in den USA und die vielen Wahlen in Schwellenländern weiterhin für Schlagzeilen sorgen und auf kurze Sicht Einfluss auf die Entwicklung der Aktienrenditen in den Schwellenländern haben. Das Team ist jedoch der Ansicht, dass der Rückenwind durch eine niedrigere Inflation und sinkende Zinssätze zusammen mit einem potenziellen Aufschwung im Halbleiterzyklus (der sich auf IT, unsere größte Übergewichtung, auswirkt) für die Anlageklasse und das Portfolio im Jahr 2024 Gutes verheißen sollte.

Aus Bottom-up-Perspektive besitzen wir eine Reihe an Namen mit hoher Überzeugungskraft, die in Bereichen agieren, die in unseren Augen unabhängig von den globalen BIP-Raten ein nachhaltiges Wachstumspotenzial bieten. Wir denken daher, dass das Portfolio für das kommende Jahr gut aufgestellt ist.

Emerging Markets Select Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Portfolios am 7. September 2023 betrug die Gesamtrendite für die Thesaurierende Klasse USD I 3,83 %. Der als Benchmark dienende MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 5,15 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Aktien aus Schwellenländern (EM) legten in diesem Berichtszeitraum zu. Der Optimismus, dass die US-Notenbank im Jahr 2024 mit einer Zinssenkung beginnen könnte, wurde durch die Schwäche in China konterkariert, so dass EM-Aktien sowohl hinter den Aktien internationaler Industrieländer (MSCI World) als auch hinter denen der USA (S&P 500) hinterher hinkten.
- Innerhalb des Index verbuchten die Energie-, IT- und Industriekomponenten bis Anfang September eine Outperformance, während Versorger, Gesundheitswesen und Immobilien nachgaben.
- Nach Ländern betrachtet, legten Griechenland und Ungarn in diesem Berichtszeitraum am meisten zu. Kolumbien und Südafrika verzeichneten die größten Verluste.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl und die Übergewichtung der starken Sektoren Energie und IT war der Wertsteigerung förderlich.
  - Nach Ländern betrachtet, leisteten Aktien aus Taiwan, Südafrika und Saudi-Arabien die größten Wertbeiträge.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Portfolio blieb hinter dem Index zurück, was vor allem auf die Einzeltitelauswahl unter Nicht-Basiskonsumgütern und Finanzwerten zurückzuführen war.
  - Auf Länderbasis schadeten Beteiligungen in China am meisten, gefolgt von unserem nicht im Index enthaltenen Engagement bei EM-Titeln mit Sitz in Großbritannien und koreanischen Aktien.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Als Ergebnis einer Bottom-up-Einzeltitelauswahl lagen die größten Übergewichtungen des Portfolios zum Ende des Berichtszeitraums in den Bereichen IT, Basiskonsumgüter und Industriewerte. Zu den Untergewichtungen gehörten Werkstoffe, Kommunikationsdienste und Versorger.
- Zu den größten Länderübergewichtungen gehörten Allokationen von außerhalb der Benchmark zu in den USA und im Vereinigten Königreich notierten Titeln mit Nischeninteressen in wichtigen Schwellenländern sowie Hongkong. China, Malaysia und Saudi-Arabien waren die wichtigsten Untergewichtungen des Portfolios.

Das Portfolio wurde am 7. September 2023 geschlossen. Wir danken Ihnen für die Gelegenheit, Sie bei der Erfüllung Ihrer finanziellen Bedürfnisse zu unterstützen.

Euro Bond – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 9,94 %. Der Bloomberg Euro Aggregate Index (Total Return, Hedged, EUR) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 7,19 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die ersten drei Quartale des Jahres 2023 wurden durch die aggressive Geldpolitik der Europäischen Zentralbank (EZB) beeinflusst, die ihren Leitzins um 200 Basispunkte (Bp) anhob. Trotz der Spannungen im Bankensektor lag die Priorität der EZB darauf, die monetären Bedingungen zu verschärfen, um die Auswirkungen des Inflationsanstiegs zu bekämpfen – sie lag über 5 % - und auf die Lohnsteigerungen zu reagieren.
- Im letzten Quartal 2023 hörte die EZB mit ihren Leitzinserhöhungen auf, da der EZB-Rat der Ansicht war, dass sie ein Niveau erreicht hatten, das, wenn es „für eine ausreichend lange Zeit beibehalten wird, einen wesentlichen Beitrag zur rechtzeitigen Rückkehr der Inflation zur Zielmarke leisten wird".
- Die Konjunktur in der Eurozone blieb über das ganze Jahr hinweg schwach, mit einer leichten Rezession im Industriesektor in Nordeuropa und einem robusten Wachstum in Südeuropa dank der Unterstützung durch die öffentlichen Ausgaben. In den letzten beiden Monaten des Jahres gab es Anzeichen, dass das Wachstum die Talsohle erreicht hatte, doch führte dies nicht zu einem Anstieg der Unternehmensausfälle, was für die Kreditmärkte positiv ist.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Der Hauptgrund für die Outperformance des Portfolios gegenüber dem Index war die Emittentenauswahl, wobei die Rally zum Jahresende besonders stark war.
  - Die Verwaltung unseres Zinsengagements erwirtschaftete zusätzliche Erträge, hauptsächlich durch die Renditekurvenpositionierung.
  - Unsere Sektorrotation war im Jahr 2023 erfolgreich. Die Spannungen im Bankensystem im ersten Quartal veranlassten uns, unsere Gewichtung im Finanzsektor zu erhöhen, während die niedrigeren Kosten im Energiesektor zu einer Aufstockung bei Investitionsgütern in der zweiten Jahreshälfte führten.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Derivate beeinträchtigten die Wertentwicklung bedingt durch den Kauf von Kreditabsicherungen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Zu Beginn des Jahres 2023 war unsere Duration untergewichtet, doch wurde sie Anfang März im Zuge der Spannungen im Bankensystem wieder auf neutral gesetzt. Im zweiten Quartal hatten wir durch die hohe Marktvolatilität die Gelegenheit, unser Durationsengagement schrittweise auf bis zu 1 Jahr zu erhöhen, wobei wir in erster Linie Anleihen mit einer 5-jährigen Laufzeit kauften. Bis zum Jahresende haben wir angesichts der sinkenden Zinsen die Gewinne realisiert und unsere Durationsübergewichtung auf eine Untergewichtung umgestellt.
- Außerdem haben wir unsere Länderallokation aktiv gesteuert. Im ersten Quartal schlossen wir unser untergewichtetes Engagement bei italienischen Staatsanleihen, um wieder auf eine neutrale Position zu kommen. Als wir die Duration wieder erhöhten, geschah dies mithilfe deutscher Bundesanleihen und mit Swap-Spread-Produkten auf Kosten von Semi-Kernländern wie Frankreich.
- Über das ganze Jahr hinweg haben wir ein übergewichtetes Kreditengagement gesteuert, um von der Marktvolatilität und den sich auf dem Primärmarkt bietenden Anlagegelegenheiten zu profitieren. Wir hatten hauptsächlich BBB-Emittenten und Hochzinsanleihen übergewichtet, die am empfindlichsten auf die Marktentwicklung reagierten.

Wir denken, dass der Fokus der Märkte im neuen Jahr darauf liegen wird, wie schnell und wie niedrig die Inflation in Abhängigkeit von den Ergebnissen der Lohnverhandlungen fallen wird. Wir glauben, dass die EZB erst dann ihre restriktive Politik aufgeben wird, wenn die Inflation nachhaltig auf ihr Ziel von 2 % sinkt. Dies verstärkt die Risiken durch eine zu restriktive Geldpolitik, die zu einer harten Rezession führen könnte, und Dies sollte den Anstieg der realen Renditen begrenzen und die Kurse am Rentenmarkt stützen.

Euro Bond Absolute Return – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 8,17 %. Der ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 2,46 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die ersten drei Quartale des Jahres 2023 wurden durch die aggressive Geldpolitik der Europäischen Zentralbank (EZB) beeinflusst, die ihre Leitzinsen um 200 Basispunkte (Bp) anhob. Trotz der Spannungen im Bankensektor lag die Priorität der EZB darauf, die monetären Bedingungen zu verschärfen, um die Auswirkungen des Inflationsanstiegs, der über 5 % lag, auf die Löhne zu bekämpfen.
- Im letzten Quartal 2023 hörte die EZB mit ihren Leitzinserhöhungen auf, da der EZB-Rat der Ansicht war, dass sie ein Niveau erreicht hatten, das, wenn es „für eine ausreichend lange Zeit beibehalten wird, einen wesentlichen Beitrag zur rechtzeitigen Rückkehr der Inflation zur Zielmarke leisten wird".
- Die Konjunktur in der Eurozone blieb über das ganze Jahr hinweg schwach, mit einer leichten Rezession im Industriesektor in Nordeuropa und einem robusten Wachstum in Südeuropa dank der Unterstützung durch die öffentlichen Ausgaben. In den letzten beiden Monaten des Jahres gab es Anzeichen, dass das Wachstum die Talsohle erreicht hatte, doch führte dies nicht zu einem Anstieg der Unternehmensausfälle, was für die Kreditmärkte positiv ist.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Der Hauptgrund war die Emittentenauswahl, wobei die Rally zum Jahresende besonders stark war.
  - Die Verwaltung unseres Zinsengagements erwirtschaftete zusätzliche Erträge, hauptsächlich durch die Renditekurvenpositionierung.
  - Long-Swap-Spreads über Zinsswaps und Proxy-Swaps waren gegenüber Staatsanleihen aus Kernländern erfolgreich.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Absicherung von hochverzinslichen Credit Default Swaps mit iTraxx Crossover beeinträchtigte die Performance.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Duration war zu Anfang 2023 gering und wurde gegen Anfang März im Rahmen der Spannungen im Bankensystem wieder auf 2-2,5 Jahre erhöht. Im zweiten Quartal hatten wir durch die hohe Marktvolatilität die Gelegenheit, unser Durationsengagement auf 4 Jahre zu erhöhen, wobei wir in erster Linie Anleihen mit einer 5-jährigen Laufzeit gekauft haben. Zum Jahresende nahmen wir während der Rally am Euro-Markt schrittweise die Gewinne mit und steuerten die Portfolioduration wieder in Richtung auf 2,5 Jahre.
- Außerdem haben wir unsere Länderallokation aktiv gesteuert. Im ersten Quartal, als sich der Spread gegenüber deutschen Bundesanleihen der Marke von 200 Bp näherte, schlossen wir unsere absolute Short-Duration in Italien, während wir bei spanischen und portugiesischen Staatsanleihen investiert blieben. Als wir die Duration zurückbrachten, geschah dies über Swap-Kontrakte im kurz- bis mittelfristigen Kurvenbereich und Proxy-Swaps (Agenturen, gedeckte Anleihen) versus Semi-Kernländer wie Frankreich.
- Über das ganze Jahr hinweg haben wir ein umfassendes Kreditengagement gesteuert, um von der Marktvolatilität und den sich auf dem Primärmarkt bietenden Anlagegelegenheiten zu profitieren. Wir waren hauptsächlich bei Emittenten mit BBB-Rating und in Hochzinsanleihen engagiert, die am empfindlichsten auf die Marktentwicklung reagierten.

Mit Blick auf die Zukunft glauben wir, dass die Märkte ihr Augenmerk auf die Entwicklung der Kerninflation konzentrieren werden, abhängig vom Ergebnis der Lohnverhandlungen. Wir glauben, dass die EZB erst dann ihre restriktive Politik aufgeben wird, wenn die Inflation nachhaltig auf ihr Ziel von 2 % sinkt. Dies verstärkt die Risiken einer zu restriktiven Geldpolitik, die zu einer harten Rezession führen könnte. Dies sollte den Anstieg der realen Renditen begrenzen und die Kurse am Rentenmarkt stützen.

European High Yield Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 13,53 %. Im selben Zeitraum verzeichnete der als Benchmark dienende ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR) (der Index), 12,11 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der europäische Hochzinsmarkt verzeichnete trotz einiger Perioden mit Volatilität im Laufe des Jahres starke Erträge. Die Gesamtrendite des Index von 12,11 % war die höchste seit 2012. Trotz einer anfänglichen Ausweitung der Spreads im Oktober trugen die deutliche Rally zum Jahresende bei Risikoanlagen und die Spread-Verengung um rund 50 Basispunkte im letzten Quartal zusammen mit dem Carry zu den starken Renditen bei.
- Die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemittenten in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen (EBITDA), der freie Cashflow, die Zinsdeckung und der Verschuldungsgrad, hielten sich in einem recht günstigen Bereich, und die Ertragssaison fiel im Großen und Ganzen besser aus als befürchtet. Die Aussichten in Bezug auf Zahlungsausfälle blieben ebenfalls relativ günstig.
- Zwar stieg die Ausfallquote von ihren Tiefstständen im Jahr 2022, doch erwarten wir, dass die Ausfallquoten in einem Bereich knapp unter dem langfristigen Durchschnitt bleiben werden. Dieser Ausblick stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im europäischen Hochzinssegment (63 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
    - Aus sektoraler Sicht leisteten die Positionierungen in den Bereichen Auto, Verpackungen und Finanzunternehmen den größten Wertbeitrag.
    - Aus der Perspektive der Ratings trugen die Positionierungen bei Emittenten mit einem Rating von BB, B und CCC und darunter am meisten zur Wertentwicklung bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
    - Aus Sektorperspektive waren die Positionierungen in den Bereichen Freizeit, Energie sowie Nahrungsmittel & Getränke am nachteiligsten für die Performance.
    - Aus der Perspektive der Ratings zeichneten die Positionierungen bei Emittenten mit einem Rating von BBB und höher für die meisten Wertabzüge verantwortlich.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Rahmen unserer Hochzinsstrategien haben wir selektiv in qualitativ höherwertige B-Anleihen umgeschichtet, wo die Preise im Verhältnis zu den zugrunde liegenden Fundamentaldaten attraktiv blieben und die Ausfallerwartungen niedrig waren.
- Die Positionierung in Emittenten mit CCC-Rating war zum Jahresende gegenüber dem Index leicht untergewichtet. Hier haben wir eine differenzierte Sicht auf die einzelnen Unternehmensanleihen, die auf unseren hausinternen Ratings und den Einschätzungen der Analysten zu den einzelnen Krediten beruht. Zudem konzentrierten wir uns auf Umschichtungen innerhalb von Branchen und Risikokategorien des Marktes, um die Widerstandsfähigkeit gegenüber Inflations- und Lohnkostentrends zu maximieren, sofern diese fortbestehen. Außerdem haben wir das Verschuldungsprofil des Portfolios, wo dies ohne Verluste möglich war, heruntergefahren.
- Unser Plan war es, das Portfolio in erster Linie auf höherwertige B- und ausgewählte BB-Kreditrisiken zu konzentrieren (auf Basis unseren internen Kreditratings) und Sektoren überzugewichten, die wir im aktuellen Umfeld als widerstandsfähig einschätzen.

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen europäischer Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Da die Kreditstreuung zugenommen hat, konzentrieren sich unsere Analysten auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Darüber hinaus gehen wir davon aus, dass die Streuung zwischen Branchen, Ratingkategorien, Emittenten und Regionen weiterhin hoch sein wird, was Anlagegelegenheiten für höhere Renditen durch die Einzeltitelauswahl bietet. In diesem Zusammenhang wird sich eine gründliche Bottom-up-Kreditanalyse in Verbindung mit einem engen Kontakt zu den Managementteams, den Sponsoren und Gegenparteien an der Börse als entscheidend erweisen, damit wir unser Portfolio optimieren können, um aus den gebotenen Chancen Kapital zu schlagen.

European Sustainable Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 18,99 %. Der als Benchmark dienende MSCI Europe Index (Total Return, abzüglich Steuern, EUR) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 15,83 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Aktienmärkte begannen das Jahr 2023 mit einer kräftigen Erholung, da sich die Inflation abschwächte, doch gab es auch Gegenwind durch die Zentralbanken, die die Zinssätze im Laufe des Jahres weiter anhoben.
- Gegen Mitte des Jahres führten Rezessionsängste und Spannungen im Finanzsektor, einschließlich des Zusammenbruchs namhafter US-Regionalbanken zu Beginn des Jahres, zu einer erhöhten Volatilität und Marktschwäche.
- Die Märkte beendeten das Jahr jedoch mit einer robusten Performance, unterstützt durch den Optimismus hinsichtlich einer gelockerten Geldpolitik und sinkender langfristiger Zinses, da der Inflationsdruck nachließ.
- Die US-Wirtschaft zeigte starkes Wachstum, im Gegensatz zu Europa und Japan, wo sich die Konjunktur abschwächte.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Eine übergewichtete Sektorallokation gegenüber dem Index in IT und von Industriewerten trug am meisten zur Performance bei.
  - Die Einzeltitelauswahl unter Finanzwerten und im Gesundheitswesen.
  - Eine Untergewichtung im Energiesektor, weil die Nachfrage nach Öl und Gas vor dem Hintergrund eines sich abschwächenden globalen Wirtschaftswachstums unter Druck geriet.
  - Auf Aktienebene trugen die Beteiligungen an in 3i Group, Partners Group, London Stock Exchange Group (Finanzwerte), VAT Group und Schneider (Industriewerte) am meisten zur Performance bei.
- Negativbeiträge zur relativen Gesamtrendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Bereich der Nicht-Basiskonsumgüter aufgrund des Gegenwinds durch nachlassende Konsumausgaben.
  - Aktien von Alfen (Industriewerte), SolarEdge Technologies (IT), Bakkafrost (Basiskonsumgüter) und Sartorius Stedim Biotech (Gesundheitswesen) waren für die größten Wertabzüge verantwortlich.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben das vertikal integrierte Unternehmen Essilor Luxottica (Augenpflege) in das Portfolio aufgenommen. Das Unternehmen profitiert von strukturellen Trends wie z. B. der zunehmenden Kurzsichtigkeit und einer alternden Bevölkerung.
- Des Weiteren haben wir Reply aufgenommen, ein IT-Beratungs- und digitales Dienstleistungsunternehmen mit einem einzigartigen dezentralisierten Netzwerk von auf Nischen spezialisierten Unternehmen, die ihren Kunden bei der Verbesserung in Bereichen wie Ressourceneffizienz und Cybersicherheit helfen.
- Unsere Position in Cellnex wurde aufgrund des begrenzten Potenzials für Tarifsteigerungen in einem Hochinflationsumfeld veräußert. Wir denken, dass das Unternehmen bei der Verwaltung seiner Kostenbasis und seiner fremdfinanzierten Bilanz mit erheblichen Herausforderungen konfrontiert ist.
- Die Position im Tierarzneimittelunternehmen Dechra wurde nach einem Private-Equity-Angebot verkauft.

Das wirtschaftliche Umfeld stellt weiterhin eine Herausforderung dar, mit Unsicherheiten in Bezug auf Inflation, die Zentralbankpolitik, Wahlergebnisse und geopolitische Entwicklungen. In diesem Zusammenhang gehen wir weiterhin davon aus, dass unser Ansatz der richtige ist: die Verwaltung eines fokussierten Portfolios von Qualitätsunternehmen mit einer dauerhaften Wettbewerbsposition, einem starken Management wesentlicher ESG-Aspekte und der Fähigkeit, sich an Veränderungen anzupassen. Wir glauben, dass solche Unternehmen, die wir als „Transition Winners" bezeichnen, gut gerüstet sind, um langfristig zu wachsen. Dies gilt umso mehr in unsicheren Zeiten, da der Fokus dieser Unternehmen auf Nachhaltigkeit ihren Wettbewerbsvorteil weiter stärkt.

Event Driven – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 4,25 %. Der S&P 500 Index* (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 25,67 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die erste Jahreshälfte (sogar ab November 2022) war eine der seit Jahrzehnten schwierigsten Perioden für Risikoarbitrage, die durch zahlreiche gescheiterte Transaktionen und rechtliche Herausforderungen gekennzeichnet war. Wir haben diese Periode erfolgreich durchlaufen und konnten dank unseres tiefgreifenden, fundamentalen Researchprozess zu Risiken und Chancen allen gescheiterten Transaktionen aus dem Weg gehen. Wir waren in der Lage, aus den weiteren Spreads bei solchen Anlagegelegenheiten Kapital zu schlagen, bei denen die Regulierungsbehörden letztlich erfolglos versucht hatten, Transaktionen zu blockieren.
- Nach einer Reihe von gerichtlichen Niederlagen verfolgten die Aufsichtsbehörden einen rationaleren Ansatz bei der Bewertung von Transaktionen. Dies bedeutet nicht, dass die Aufsichtsbehörden kartellrechtliche Vorschriften nicht aggressiv verfolgen werden oder dass das Pendel vollständig zurückgeschwungen ist, es deutet jedoch daraufhin, dass bestimmte Situationen investitionsfähiger werden könnten. Darüber hinaus wird diese ein wenig entspanntere Haltung wahrscheinlich mehr Transaktionen ermutigen, da die Verwaltungsräte das derzeitige regulatorische Umfeld verarbeiten.
- Auf Seite der Strategie Market Neutral Calalyst (marktneutraler Katalysator) ergaben sich gute Anlagegelegenheiten, da eine größere Zahl an Unternehmen verschiedene Formen von Kapitalmaßnahmen in Erwägung zogen, um den Shareholder Value in einem unsicheren makroökonomischen Umfeld zu steigern. Wir müssen allerdings geduldig bleiben, um diese Wertschöpfung zu realisieren, da es Zeiten gibt, in denen eine durch Beta angetriebene Rally (z. B. Januar, Juni, November und Dezember) mit einem stark abgesicherten Beta und neutralem Stilfaktor kurzfristig für Gegenwind sorgen kann.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Sowohl die Strategie Risiko Arbitrage als auch die Strategie Market Neutral Catalyst leisteten positive Wertbeiträge.
  - Die besten Performancebeiträge kamen von Uber Technologies (Catalyst), Meta Platforms (Catalyst), US Steel (Risiko), Activision Blizzard (Risiko) und Broadcom (Catalyst).
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Die fünf Titel verantwortlich für die größten Negativbeiträge waren Willscot Mobile Mini (Catalyst), NextEra Energy (Catalyst), Dollar Tree (Catalyst), Bristol-Meyers Squibb (Catalyst) und PayPal (Catalyst).

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das investierbare Universum für die Risiko-Arbitrage-Strategie war im Jahr 2023 kleiner. Einfache Transaktionen mit begrenzter aufsichtsrechtlicher Komplexität wurden zu eng bepreist und boten kein attraktives Risiko-/Ertragsprofil, da diese „sicheren" Transaktionen im Fokus von speziellen Risiko-Arbitrage-Strategien standen. Das Universum der Transaktionen, in die wir investiert haben, lieferte trotz eines nur geringeren Engagements sehr attraktive absolute und risikobereinigte Renditen für das Portfolio.
- In Bezug auf die Strategie Market Neutral Catalyst fanden wir eine Reihe von idiosynkratischen Anlagegelegenheiten für den Kapitaleinsatz. Wir tendierten zu einem höheren Prozentsatz an weichen Titeln gegenüber katalytischen Titeln, da wir sie unserer Meinung nach effizienter absichern können. Außerdem haben wir die durchschnittliche Positionsgröße etwas kleiner gehalten, während sie an Überzeugungskraft gewinnen und der Zeitraum bis zum tatsächlichen Ereignis kürzer wird.

Wir erwarten, dass die Risikovolumina Anfang 2024 deutlich ansteigen werden, da die Unternehmen nach Jahren mit Marktvolatilität, mit Inflation und der Unterbrechung der Lieferkette ihr Wachstum fortsetzen und der Druck auf die Kapitalkosten nachlässt. Die Welt ist angesichts der geopolitischen Situation, der makroökonomischen Entwicklungen und eines sehr unsicheren Wahljahres in den USA nach wie vor recht instabil . Wir finden immer noch idiosynkratische Ideen mit spezifischen Katalysatoren, von denen wir annehmen, dass sie Wert schaffen oder zerstören können, und sichern Situationen mit dem Ziel ab, das Kapital in allen Szenarien zu schützen.

* Das Portfolio wird aktiv verwaltet und beabsichtigt nicht, den Index nachzubilden. Er wird hier lediglich zu Zwecken des Vergleichs der Wertentwicklung herangezogen.

Global Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 6,54 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, Unhedged, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 5,72 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve und die Europäische Zentralbank hoben die Leitzinsen um 100 Bp bzw. 200 Bp an.
- Die Zinsvolatilität war das ganze Jahr über hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies trug zu einer erheblichen Rally bei Staatsanleihen und Aktien bei.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für globale Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade verengten sich um 32 Bp bzw. 122 Bp.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung von hypothekarisch besicherten Wertpapieren (MBS) und der Allokation zu Kreditrisikotransfers.
  - Das übergewichtete Engagement und die Einzeltitelauswahl bei globalen Unternehmensanleihen mit Investment Grade.
  - Die Untergewichtung britischer Zinsen, eine Übergewichtung der Zinssätze europäischer Kernländer und die US-Renditekurvenpositionierung.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtung von Zinsen in China und Japan.
  - Das aktive Devisen-Overlay des Portfolios.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir erhöhten das Engagement bei quasistaatlichen MBS und europäischen Investment-Grade-Unternehmensanleihen und reduzierten die Gewichtung von US-amerikanischen Unternehmensanleihen mit Investment Grade ebenso wie die von globalen Staatsanleihen.
- Wir haben die Duration des Portfolios um ca. ein dreiviertel Jahr erhöht, bleiben aber auf Kernebene bei der Duration untergewichtet.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zweiteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen könnte. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

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

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 5,84 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve und die Europäische Zentralbank hoben die Leitzinsen um 100 Bp bzw. 200 Bp an.
- Die Zinsvolatilität war das ganze Jahr über hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies startete eine erhebliche Rally bei Staatsanleihen und Risikoanlagen.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für US-amerikanische Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade (IG) verengten sich um 32 Bp bzw. 122 Bp.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Das Engagement in Unternehmensanleihen mit Investment Grade aus Industrieländern.
  - Das Engagement in Hochzinsanleihen aus Industrieländern.
  - Das Engagement in Unternehmensanleihen aus Schwellenmärkten.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Aus Sektorperspektive gab es keine wesentlichen Negativbeiträge.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio war in verschiedenen Kreditsektoren sowie über Ratingkategorien und Regionen investiert.
- Am Ende des Berichtszeitraums stellten Investment-Grade-Unternehmensanleihen die größte Sektorallokation dar, gefolgt von EM-Unternehmensanleihen und Hochzinsanleihen.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zweiteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

Global Equity Megatrends – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 22,91 %. Der als Benchmark dienende MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 23,79 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im vergangenen Jahr überraschten die globalen Aktienmärkte die meisten Prognostiker mit gesunden, positiven Renditen. Die Anleger nahmen die geopolitischen Konflikte anstandslos hin, und auf makroökonomischer Ebene stützten die in den meisten großen Volkswirtschaften gesunden Arbeitsmärkte weiterhin den weltweiten Konsum (außer in China). Da sich die Lieferketten weiter normalisierten, ließ der Inflationsdruck weiter nach.
- Die Performance von Unternehmen war uneinheitlich, wobei sowohl makroökonomische Ängste als auch die langwierigen Folgen der Ungleichgewichte durch COVID-19 die Ergebnisse beeinträchtigten.
- Wir denken, dass die Bewertungsverzerrungen an den Aktienmärkten fortbestehen. „Indexlieblinge" und „Story-Aktien" werden weiterhin mit hohen Multiplikatoren bewertet, während viele andere Unternehmen auf der Strecke bleiben.
- Die impliziten Werte einer beträchtlichen Anzahl unserer Unternehmen im Portfolio spiegeln weiterhin ein hohes Maß an Zukunftsunsicherheit wider, eine ermutigende Grundlage für geduldige Anleger.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Die besten Wertbeiträge kamen u. a. von Expedia Group, Uber (beide Globaler Verbrauch) und Vistra Corp. (Energieinfrastruktur).
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - ModivCare (Health & Wohlbefinden), Alibaba (Globaler Verbrauch) und Criteo (Smart Systems) gehörten zu den Titeln verantwortlich für mit die größten Abzüge von der Performance.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im vergangenen Jahr haben wir zwei neue Unternehmen in das Portfolio aufgenommen, nämlich Uber (Globaler Verbrauch) und Element Solutions (Energieeffizienz), und unser Engagement bei ModivCare (Health & Wohlbefinden) und Criteo (Smart Systems) erhöht.
- Wir finanzierten diese Investitionen durch die Reduzierung oder Beendigung unserer Beteiligungen an Quanta Services (Energieinfrastruktur), AON (Health & Wohlbefinden), Element Fleet Management (Energieeffizienz) und Paya Holdings (Globaler Verbrauch). Letzterer Titel wurde zu Anfang des Jahres erworben.

Wir sind weiterhin von unseren Portfoliobeständen begeistert. Es wird erwartet, dass diese Unternehmen in den kommenden Jahren zwar ein jährliches Wachstum des freien Cashflows von 23 % erzielen werden, aber zu sehr hohen freien Cashflow-Renditen gehandelt werden. Tatsächlich handelt es sich um Bewertungen, die wir seit langem nicht mehr gesehen haben. Diese Konstellation bietet ein attraktives Risiko-Ertrags-Verhältnis, das unserer Meinung nach mit einer erheblichen Sicherheitsmarge kommt. Darüber hinaus ist es ermutigend, dass viele Portfoliounternehmen an „Effizienz" gewinnen, z. B. durch Technologien, Produkte und Dienstleistungen, die es ihren Kunden ermöglichen, „mehr mit weniger" zu erreichen. Dies ist zwar immer ein wertvolles Geschäftskonzept, aber zu Zeiten des wirtschaftlichen Abschwungs ist es besonders wichtig.

Global Flexible Credit Income – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 12,52 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve und die Europäische Zentralbank hoben die Leitzinsen um 100 Bp bzw. 200 Bp an.
- Die Zinsvolatilität war das ganze Jahr über hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies führte zu einer erheblichen Rally bei Staatsanleihen und Risikoanlagen.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für US-amerikanische Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade (IG) verengten sich um 32 Bp bzw. 122 Bp.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Das Engagement in Hochzinsanleihen aus Industrie- und Schwellenländern leistete den größten Wertbeitrag.
  - Die Engagements bei Investment-Grade-Unternehmensanleihen und besicherten Schuldtiteln (Collateralized Loan Obligations) generierten einen untergeordneten Wertbeitrag.
  - Das Engagement in verbrieften Krediten leistete einen kleinen positiven Wertbeitrag.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Aus Sektorperspektive gab es keine wesentlichen Negativbeiträge.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio war in verschiedenen Kreditsektoren sowie über Ratingkategorien und Regionen investiert.
- Wir haben unser Engagement in US_Hochzinstiteln heruntergefahren und erhöhten unsere Gewichtung von europäischen Hochzinsanleihen, Schwellenländeranleihen, europäischen Investment-Grade-Unternehmensanleihen und verbrieften Krediten.
- Wir haben die Duration des Portfolios um etwa eindreiviertel Jahre erhöht.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zweiteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

Global SDG Engagement – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 10,29 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged,USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 12,97 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der globale Markt für Hochzinsanleihen beendete den Berichtszeitraum mit starken Renditen, die von der Risikobereitschaft gegen Jahresende angetrieben wurden, als die Spreads zurückgingen und die Märkte für 2024 trotz robuster Wirtschaftsdaten Zinssenkungen einpreisten. Für das Kalenderjahr 2023 waren die Renditen von Hochzinsanleihen die höchsten seit 2019.
- Abgesehen von den risikoreicheren osteuropäischen und chinesischen Immobiliensektoren hielten sich die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemittenten in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen, der freie Cashflow, die Zinsdeckung und der Verschuldungsgrad einem recht günstigen Bereich, und die Ertragssaison fiel im Großen und Ganzen besser aus als befürchtet. Die Aussichten in Bezug auf Zahlungsausfälle blieben ebenfalls relativ günstig.
- Es wird erwartet, dass die Ausfallquoten in den USA, in Europa und anderen Industrieländern durchschnittlich bleiben werden, nachdem sie sich von den im Jahr 2022 erreichten historischen Tiefstständen nach oben bewegt haben. Die Ausfälle in Schwellenländern (EM) haben zwar zugenommen, aber wir konzentrieren uns auf ausgewählte Gelegenheiten außerhalb der Regionen und Sektoren mit einem höheren Risiko. Unsere Erwartung eines in etwa durchschnittlichen Ausfallrisikos stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im globalen Hochzinssegment (56 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Aus sektoraler Sicht: Positionierungen in den Segmenten Auto, Baustoffe und Chemie.
  - Aus der Sicht der Ratings eine Untergewichtung von Emittenten mit BB-Rating.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Aus Sektorsicht Positionierung in den Bereichen Energie, Festnetz und sonstige Finanzwerte.
  - Aus der Perspektive der Ratings: Positionierung in Emittenten mit einem Rating von B, CCC und darunter sowie BB.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Rahmen unserer Hochzinsstrategien haben wir selektiv in qualitativ höherwertige BB-Anleihen umgeschichtet, wo die Preise im Verhältnis zu den zugrunde liegenden Fundamentaldaten attraktiv blieben und die Ausfallerwartungen niedrig waren.
- Bei den CCC-Positionierungen haben wir eine differenzierte Sicht auf die einzelnen Unternehmensanleihen, die auf unseren hausinternen Ratings und den Einschätzungen der Analysten zu den einzelnen Krediten beruht. Zudem konzentrierten wir uns auf Umschichtungen innerhalb von Branchen und Risikokategorien des Marktes sowie über Regionen, um die Widerstandsfähigkeit gegenüber Inflations- und Lohnkostentrends zu maximieren, sofern diese fortbestehen. Außerdem haben wir das Verschuldungsprofil des Portfolios, wo dies ohne Verluste möglich war, heruntergefahren.
- Unser Plan war es, das Portfolio in erster Linie auf BB- und höherwertige B-Kreditrisiken zu konzentrieren (auf Basis unseren internen Kreditratings) und Sektoren überzugewichten, die wir im aktuellen Umfeld als widerstandsfähig einschätzen. Das Portfolio ist bei US-amerikanischen und europäischen Hochzinsanleihen übergewichtet und hat EM-Hochzinsanleihen untergewichtet.

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen von Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Da die Kreditstreuung zugenommen hat, konzentrieren sich unsere Analysten auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Trotz potenzieller kurzfristiger Volatilität, die sich aus der Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen" in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

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

Für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Portfolios am 16. Juni 2023 betrug die Gesamtrendite für die Thesaurierende Klasse USD I 4,32 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der globale Markt für Hochzinsanleihen beschloss den Berichtszeitraum mit soliden Renditen, die vor allem darauf beruhten, dass die Wirtschaftsdaten robuster ausfielen als erwartet, aber auch auf die Erträge der meisten Emittenten. Das galt ungeachtet der Volatilitätsschübe, die von Sorgen um höhere Inflation ausgelöst wurden, der restriktiveren Zentralbankpolitik, der Minibankenkrise und des zunehmenden Rezessionsrisikos im ersten Halbjahr.
- Die Ausfallquoten in den USA, in Europa und anderen Industrieländern dürften durchschnittlich bleiben, nachdem sie sich von den im Vorjahr erreichten historischen Tiefstständen nach oben bewegt haben. Die Ausfälle in Schwellenländern (EM) nehmen zwar zu, aber wir konzentrieren uns auf ausgewählte Gelegenheiten außerhalb der Regionen und Sektoren mit höherem Risiko. Bei EM-Hochzins-Unternehmensanleihen betrug die Ausfallquote insgesamt in diesem Jahr anfangs um die 15 Prozent. Grund dafür sind ausbleibende Zahlungen russischer und ukrainischer Emittenten und die erhöhte Zahl an Ausfällen im chinesischen Immobiliensektor. Abgesehen von diesen spezifischen Bereichen rechnen wir mit einer eher gemäßigten Ausfallquote für hochverzinsliche EM-Unternehmensanleihen, da die EM-Unternehmen mit einer im Durchschnitt angemessenen Liquidität in diesen Zeitraum eintraten.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Die Positionierung in Emittenten mit B-, BB-, CCC- und schlechteren Ratings sowie mit BBB- und besseren Ratings.
  - Die Positionierung in den Sektoren Support-Dienstleistungen, Gesundheitswesen und Baustoffe.
- Negative, neutrale oder besonders geringe Beiträge zur absoluten Rendite:
  - Die Positionierung in Emittenten ohne Rating wirkte ergebnisneutral.
  - Die Positionierung im Sektor Medien und Kabel minderte die Wertentwicklung.
  - Die Sektoren Druck und Verlagswesen sowie Papier steigerten die Erträge am geringsten.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 geschlossen.

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 9,60 %. Der Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return, abgesichert, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 9,10 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Jahr 2023 begann mit einer erheblichen Volatilität an den Kreditmärkten, wobei sich die Spreads einengten. Der Grund war die erwartete Abschwächung der US-Inflation und der Aussichten auf eine Verbesserung des globalen Wachstums nach der überraschenden Ankündigung Chinas, seine Wirtschaft rasch wieder öffnen zu wollen. Anfang März weiteten sich die Kreditspreads aufgrund von Ereignissen im Bankensektor: die Silicon Valley Bank wurde am 10. März unter Konkursverwaltung gestellt und die Schweizer Regierung vermittelte am 19. März die Übernahme der Credit Suisse durch die UBS. Später in der ersten Jahreshälfte ließen die Bedenken im Bankensektor nach, nachdem sich herausgestellt hatte, dass andere regionale US-Banken sowie global systemrelevante Banken besser von diesem Druck abgeschirmt waren.
- Die angespannten Finanzbedingungen hielten an, da der Bankensektor unter Druck geriet und großen Zentralbanken im Laufe des Jahres die Leitzinsen erhöhten, wobei sie auf die nach wie vor hohen Inflationsraten verwiesen. Die Federal Reserve erhöhte das Zielband für die Leitzinsen von 4,5 % bis 4,75 % zu Beginn des Jahres 2023 auf 5,25 % bis 5,5 % im Juli 2023 und hielt es auf diesem Niveau. Die Europäische Zentralbank erhöhte den Satz für die Einlagefazilität von 2,00 % im Januar 2023 auf 4,00 % im September 2023 und hielt den Satz seitdem ebenfalls konstant. Schließlich hat dann auch die Bank of England den britischen Leitzins im Laufe des Jahres um 175 Basispunkte auf 5,25 % im August 2023 angehoben und seitdem beibehalten. Alle großen Zentralbanken bestätigen, dass die Geldpolitik derzeit restriktiv ist, wodurch ein Abwärtsdruck auf die Inflation ausgeübt werden soll.
- Als der Höchststand der Zinsen in Sichtweite kam, gaben die Renditen von Staatsanleihen im vierten Quartal nach, was den Anstieg vom Jahresanfang wieder wettmachte. Insbesondere hielt die Fed auf ihrer letzten Sitzung im Jahr 2023 die Zinssätze bei 5,25 % bis 5,50 % konstant. Im Anschluss an die geldpolitische Sitzung räumte die Fed in ihrer Stellungnahme ein, dass sich die Wirtschaftstätigkeit gegenüber dem dritten Quartal verlangsamt habe. Der Arbeitsmarkt sei zwar immer noch stark, doch habe er sich abgeschwächt und die Arbeitslosenquote bleibe niedrig. Die Prognosen der Fed gehen nun von drei möglichen Zinssenkungen im Jahr 2024 aus. Die „Kehrtwende" der Fed hinsichtlich der Zinserwartungen löste zum Jahresende eine deutliche Rally an den Renten- und Aktienmärkten aus.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Vorrangige unbesicherte Anleihen aus den Sektoren Technologie und Kommunikation, Grundstoffe, Immobilien und Konsumgüter trugen zur Outperformance bei.
  - Nachrangige Tier-2-Schuldtitel von Versicherungsunternehmen leisteten ebenfalls einen positiven Beitrag zur Performance.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Demgegenüber schmälerte der Bankensektor die Performance leicht.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir beteiligten uns im Jahr 2023 an einer Reihe attraktiv bepreister Neuemissionen auf dem Primärmarkt, die dem Portfolio eine starke relative Outperformance bescherten. Wir erwarben nachrangige Tier-2-Bankanleihen großer national führender britischer und europäischer Institute und stockten in volatilen Marktphasen Anfang März 2023 auch Positionen in US-Großbanken auf, die für uns einen hohen Überzeugungsgrad aufweisen. Unsere Position in den erstrangigen unbesicherten Holdco-Anleihen der Credit Suisse behielten wir bei. Diese verzeichnete eine rasche Verengung der Spreads nach der ausgehandelten Übernahme durch die UBS mit erheblicher Spread-Outperformance.
- Die Durationspositionierung des Portfolios wurde im Jahresverlauf weitgehend in der Nähe des Benchmarkniveaus beibehalten. Wir haben jedoch in Zeiten mit einer relativen Unterperformance der Renditen auf in Pfund Sterling denominierte Unternehmensanleihen in der ersten Hälfte des Jahres 2023 unsere Durationspositionierung in Pfund Sterling nach oben gefahren. Außerdem erhöhten wir die Durationspositionierung des Portfolios in US-Dollar im dritten Quartal 2023, als sich die Renditen von US-Unternehmensanleihen auf relativer Basis unterdurchschnittlich entwickelten.

Zum Start in das Jahr 2024 bleiben wir übergewichtet in manchen der defensiveren Sektoren wie Versorger und Banken sowie in einigen zyklischen Sektoren mit höherem Beta wie Immobilien. Wir bleiben übergewichtet in Sektoren mit starken Fundamentaldaten, die sich derzeit im Verschuldungsabbau befinden, wie Kommunikationsdienste, die unseres Erachtens weiterhin von einem von steigenden Zinsen geprägten Umfeld profitieren sollten. Wir sind untergewichtet in Sektoren wie nicht-zyklische Konsumgüter, die wir für stärker gefährdet einschätzen, Fremdkapital zur Finanzierung von Aktionärsrenditen über Aktienrückkäufe und M&A-Aktivitäten einzusetzen und die zu relativ angespannten Bewertungen gehandelt werden.

Global Opportunistic Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 6,23 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, Hedged, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 7,15 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve und die Europäische Zentralbank hoben die Leitzinsen um 100 Bp bzw. 200 Bp an.
- Die Zinsvolatilität war das ganze Jahr über hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies trug zu einer erheblichen Rally bei Staatsanleihen und Aktien bei.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für globale Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade verengten sich um 32 Bp bzw. 122 Bp.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Allokationen zu europäischen Hochzinstiteln, Schwellenländeranleihen und Kreditrisikotransfer.
  - Einzeltitelauswahl bei globalen Unternehmensanleihen mit Investment Grade und quasistaatlichen Mortgage Backed Securities (MBS).
  - Die Übergewichtung von quasistaatlichen MBS.
  - Das aktive Devisen-Overlay des Portfolios.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtung in globalen Unternehmensanleihen mit Investment Grade.
  - Eine Untergewichtung von gedeckten Anleihen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Laufe des 12-Monatszeitraums erhöhten wir unser Engagement in quasistaatlichen MBS und Unternehmensanleihen mit Investment Grade und reduzierten die Gewichtung von globalen Hochzinsanleihen und Schwellenländeranleihen.
- Im zweiten Quartal gingen wir von einer untergewichteten zu einer übergewichteten Duration über. Zum Jahresende behielten wir die Übergewichtung auf einem etwas niedrigeren Niveau bei, da wir nach dem Anstieg der Renditen auf Staatsanleihen im vierten Quartal die Gewinne mitnahmen.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zweiteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

Global Real Estate Securities – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 7,65 %. Die Benchmark, der FTSE EPRA/Nareit Developed Real Estate Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im gleichen Zeitraum 9,74 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der globale Aktienmarkt erlebte im Laufe des Jahres einen signifikanten Aufschwung, unterstützt durch ein besseres Wirtschaftswachstum, eine nachlassende Inflation und die Erwartung weiterer geldpolitischer Lockerungen durch die großen Zentralbanken.
- Die Verschärfung der Kreditbedingungen im Anschluss an die regionale Bankenkrise in den USA und die geringen Transaktionsvolumina drückten die Stimmung in Bezug auf Immobilien, doch wurde sie durch die starken Signale, dass die Zinssätze ihren Höhepunkt erreicht haben, verbessert.
- Eine deutliche Markterholung ab Ende Oktober ließ die Rendite des Index auf das Jahr gerechnet auf ein Plus von 9,74 % ansteigen, während der MSCI ACWI im gleichen Zeitraum eine Rendite von 22,20 % verbuchte.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Eine Übergewichtung von Spanien und eine Untergewichtung von Japan.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Büroraum.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Wohnraum.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Eine Untergewichtung gegenüber den USA und Deutschland.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Einzelhandel.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Immobilien-Holdings und Bauträger.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios lag überwiegend eine Bottom-up-Einzeltitelauswahl zugrunde. Am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größten Übergewichtungen im Verhältnis zum Index in den Sektoren Infrastruktur-REITs und Selbsteinlagerung. Die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren waren Diversified und Büroraum.
- Nach Ländern bestanden die größten Übergewichtungen im Vereinigten Königreich und in Spanien, die größten Untergewichtungen in den USA und in Australien.

Nach einem schwierigen Jahr 2023, das weitgehend von der geldpolitischen Straffungskampagne der US-Notenbank diktiert wurde, erscheint uns das Zinsumfeld für 2024 vielversprechend. Die US-Notenbank legt in der ersten Jahreshälfte 2024 weitgehend eine Pause ein und die Anleger rechnen mit Zinssenkungen in der zweiten Jahreshälfte. Dies geschieht allerdings vor dem Hintergrund einer größeren wirtschaftlichen Unsicherheit. Die meisten europäischen Unternehmen machten bei ihren Initiativen zum Schuldenabbau Fortschritte und konnten Verkäufe von notleidenden Vermögenswerten oder größere Kreditherabstufungen vermeiden. Wir erwarten, dass sich die Aussichten der Unternehmen im Jahr 2024 weiter verzweigen werden. Auf der einen Seite nimmt der Refinanzierungsdruck für schwächere Unternehmen zu, während auf der anderen Seite stärkere Unternehmen mit höherwertigen Vermögenswerten neue Investitionen in attraktiven Sektoren wie Studentenwohnungen, Selbsteinlagerung, Datenzentren und Logistik tätigen. In Asien war Japan ein Lichtblick, doch scheint die Erholung der Aktien eher die positiven Aussichten widergespiegelt zu haben. Australien und Singapur wiesen stabile Fundamentaldaten auf. Im Fall von Hongkong bereiten die sinkenden Hauspreise und die indirekten Auswirkungen der geopolitischen Spannungen auf die chinesische Wirtschaft die meisten Sorgen. Der allgemeine Druck sollte dazu führen, dass den Bewertungen, der Ertragsqualität und der Stärke der unternehmerischen Fundamentaldaten mehr Aufmerksamkeit geschenkt wird, und unserer Meinung nach wird dies gut kapitalisierten REITs in ausgewählten Sektoren zugute kommen, deren Nachfrage weniger zyklisch oder nicht übermäßig verbraucherabhängig ist.

Global Sustainable Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 23,78 %. Der als Benchmark dienende MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 23,79 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Aktienmärkte begannen das Jahr 2023 mit einer kräftigen Erholung, da sich die Inflation abschwächte, doch gab es auch Gegenwind durch die Zentralbanken, die die Zinssätze im Laufe des Jahres weiter anhoben.
- Gegen Mitte des Jahres führten Rezessionsängste und Spannungen im Finanzsektor, einschließlich des Zusammenbruchs namhafter Banken zu Beginn des Jahres, zu einer erhöhten Volatilität und Marktschwäche.
- Die Märkte beendeten das Jahr jedoch mit einer robusten Performance, unterstützt durch den Optimismus hinsichtlich einer gelockerten Geldpolitik und sinkender langfristiger Zinses, da der Inflationsdruck nachließ.
- Die US-Wirtschaft zeigte starkes Wachstum, im Gegensatz zu Europa und Japan, wo sich die Konjunktur abschwächte.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Eine Übergewichtung gegenüber dem Index in den Sektoren Kommunikationsdienstleistungen und IT.
  - Die Einzeltitelauswahl unter Finanzwerten.
  - Auf Aktienebene trugen unsere Beteiligungen an 3i Group (Finanzen), Amazon.com (Nicht-Basiskonsumgüter), Alphabet Inc (Kommunikationsdienste), Adobe und Microsoft Corporation (IT) am meisten zur Performance bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren IT und Basiskonsumgüter.
  - Eine Untergewichtung von Versorgern, Werkstoffen, Immobilien und vor allem Energie.
  - Estée Lauder, Bakkafrost (Basiskonsumgüter), Alfen (Industrie) und SolarEdge Technologies (IT) waren für die größten Wertabzüge von der Performance verantwortlich.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben Synopsys, einen Hersteller von Software für das Halbleiterdesign, in das Portfolio aufgenommen. Das Unternehmen wird ein wichtiger Nutznießer der weiteren Digitalisierung der Gesellschaft sein, einschließlich der KI-Einführung.
- Ebenfalls hinzu kam L'Oréal, da wir davon ausgehen, dass seine sehr starke Position auf dem Schönheitsmarkt und seine kontinuierlichen Innovationsinitiativen zum Gewinn von Marktanteilen führen werden.
- Die Position in Match, einem Anbieter von Dating Services, wurde aufgrund der Unklarheit über das Abonnentenwachstum von Tinder und die zu erwartenden Herausforderungen durch Kundenabwanderung und eine sich abschwächende Wirtschaft aufgegeben.

Das wirtschaftliche Umfeld stellt weiterhin eine Herausforderung dar, mit Unsicherheiten in Bezug auf Inflation, die Zentralbankpolitik, Wahlergebnisse und geopolitische Entwicklungen. In diesem Zusammenhang gehen wir weiterhin davon aus, dass unser Ansatz der richtige ist: die Verwaltung eines fokussierten Portfolios von Qualitätsunternehmen mit einer dauerhaften Wettbewerbsposition, einem starken Management wesentlicher ESG-Aspekte und der Fähigkeit, sich an Veränderungen anzupassen. Wir glauben, dass solche Unternehmen, die wir als „Transition Winners" bezeichnen, gut gerüstet sind, um langfristig zu wachsen. Dies gilt umso mehr in unsicheren Zeiten, da der Fokus dieser Unternehmen auf Nachhaltigkeit ihren Wettbewerbsvorteil weiter stärkt.

Global Sustainable Value – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 16,70 %. Im selben Zeitraum erzielten der MSCI All Country World Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „übergeordnete Index") und der MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der „Sekundärindex") eine Rendite von 11,81 % bzw. 22,20 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die globalen Aktienmärkte erholten sich in diesem Jahr, da die Möglichkeiten der KI die Renditen antrieb, während die weltweit nachlassende Inflation die Marktstimmung für den Rest des Jahres 2023 optimistisch stimmte.
- Die US-Notenbank, die Europäische Zentralbank und die Bank of England hoben die Zinsen im Laufe des Jahres kontinuierlich an und signalisierten einen möglichen Zinssenkungszyklus im Jahr 2024.
- Die „Glorreichen Sieben"[1] trugen sowohl in den USA als auch weltweit am meisten zur Stärke bei.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung im IT-Sektor gegenüber dem übergeordnetem Index.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Kommunikationsdienste und Industrie.
  - Die Einzeltitelauswahl in den Vereinigten Staaten.
  - Die Faktoren Qualität, Momentum und Volatilität.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtung von Finanzwerten gegenüber dem übergeordnetem Index.
  - Die Einzeltitelauswahl im Gesundheitswesen.
  - Die Einzeltitelauswahl in Schwellenmärkten und in Japan.
  - Die Substanzfaktoren und Dividendenrendite.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio behielt seine Übergewichtung im Sektor IT bei. Dabei konzentrierte sich der Großteil des Engagements auf Halbleiter und Hardware, wo wir die meisten Value-Kandidaten innerhalb des Sektors finden.
- Das Portfolio war im Jahr 2023 auf rentable Aktien mit geringerer Duration ausgerichtet, während die hohe Inflation im Laufe des Jahres zurückging und die Zinsen erst stiegen und dann stagnierten.

Mit Eintritt in das Jahr 2024 denken wir, dass das Portfolio für das Marktumfeld gut positioniert ist. Wir sind der Meinung, dass der historische Kompromiss zwischen Zinsen und Inflation wiederhergestellt ist, was unsere Portfoliopositionierung zugunsten attraktiver und rentabler Unternehmen unterstützen könnte. Darüber hinaus sind wir der Ansicht, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf eine gute Kapitaldisziplin angesichts der Kreditverknappung und der unter Druck stehenden Unternehmensgewinne ebenfalls von Vorteil sein könnte.

[1] Die „Glorreichen Sieben" ist ein Spitzname für sieben technologiebezogene Mega-Caps aus dem Wachstumssegment, die deutlich besser abgeschnitten haben als der Rest der Aktien im S&P 500© Index, und setzten sich aus Alphabet (Klasse A & C), Amazon.com, Apple, Meta Platforms, Microsoft, NVIDIA und Tesla zusammen.

High Yield Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 11,36 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA US High Yield Constrained Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 13,47 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt für Hochzinsanleihen beendete 2023 mit starken Renditen, die von der Risikobereitschaft gegen Jahresende angetrieben wurden, als die Spreads zurückgingen und die Märkte für 2024 trotz robuster Wirtschaftsdaten Zinssenkungen einpreisten. Für das Kalenderjahr 2023 waren die Renditen von Hochzinsanleihen die höchsten seit 2019.
- Die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemittenten in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen, der freie Cashflow, die Zinsdeckung und der Verschuldungsgrad, hielten sich in einem recht günstigen Bereich, und die Ertragssaison fiel im Großen und Ganzen besser aus als befürchtet. Die Aussichten in Bezug auf Zahlungsausfälle bleiben ebenfalls relativ günstig.
- Zwar ist die Ausfallquote von ihren Tiefstständen im Jahr 2022 gestiegen, doch erwarten wir für 2024, dass die Ausfallquoten in einem Bereich knapp unter dem langfristigen Durchschnitt bleiben werden. Dieser Ausblick stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im Hochzinssegment (48 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
    - Aus sektoraler Sicht trugen die Positionierungen in den Sektoren Pharma, Chemie und Auto am meisten zur Performance im Berichtszeitraum bei. Aus Perspektive der Ratings leisteten die Positionierungen bei BB-Papieren und Emittenten ohne Rating den besten Wertbeitrag zur Performance im Berichtszeitraum.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
    - Aus sektoraler Sicht trugen die Positionierungen in den Sektoren Technologie, Festnetz und Einzelhandel am meisten zur Performance im Berichtszeitraum bei. Aus Sicht der Ratings beeinträchtigten Titel mit CCC-Rating und darunter, BBB und darüber sowie mit B bewertete Emittenten die Performance am stärksten.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Rahmen unserer Hochzinsstrategien haben wir selektiv in qualitativ höherwertige BB-Wertpapiere umgeschichtet, wo die Preise im Verhältnis zu den zugrunde liegenden Fundamentaldaten attraktiv blieben und die Ausfallerwartungen niedrig waren.
- Bei den CCC-Positionierungen haben wir eine differenzierte Sicht auf die einzelnen Unternehmensanleihen, die auf unseren hausinternen Ratings und den Einschätzungen der Analysten zu den einzelnen Krediten beruht. Zudem konzentrierten wir uns auf Umschichtungen innerhalb von Branchen und Risikokategorien des Marktes, um die Widerstandsfähigkeit gegenüber Inflations- und Lohnkostentrends zu maximieren, sofern diese fortbestehen. Außerdem haben wir das Verschuldungsprofil des Portfolios, wo dies ohne Verluste möglich war, heruntergefahren.
- Unser Plan war es, das Portfolio in erster Linie auf BB- und höherwertige B-Kreditrisiken zu konzentrieren (auf Basis unseren internen Kreditratings) und Sektoren überzugewichten, die wir im aktuellen Umfeld als widerstandsfähig einschätzen.

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen von Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Da die Kreditstreuung zugenommen hat, konzentrieren sich unsere Analysten auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Trotz potenzieller kurzfristiger Volatilität, die sich aus der Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen" in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

InnovAsia 5G – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 31,93 %. Der als Benchmark dienende MSCI All Country Asia (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 11,07 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das langsamere Zinserhöhungstempo der Federal Reserve führte zu einer allgemeinen Outperformance von Tech- und Growth-Werten.
- Die mit der Wiedereröffnung der chinesischen Wirtschaft nach Covid verbundenen Hoffnungen zu Beginn des Jahres schwanden, und die Stimmung verschlechterte sich angesichts einer unerwartet langsamen Erholung und begrenzter Konjunkturmaßnahmen
- Geopolitische Spannungen verstärkten die Marktvolatilität und beschleunigten die Umgestaltung der Lieferketten.
- KI wurde zu einem Anlagethema, was zu einer Rally bei den Titeln mit entsprechenden Engagements in der asiatischen Technologie-Lieferkette führte.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl in Japan und Indien, die Untergewichtung von China und die Übergewichtung von Taiwan und Südkorea gegenüber dem Index.
  - Die Einzeltitelauswahl und die Übergewichtung von Halbleitern sowie von Technologie-Hardware & Ausrüstung gegenüber dem Index.
  - KI-Gewinner unter besonders leistungsstarken Anbietern von Halbleitern, Hardware und Hochgeschwindigkeitsnetzen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Engagement in China in der ersten Jahreshälfte.
  - Die Einzeltitelauswahl in Medien & Unterhaltung.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das erhöhte Engagement im Halbleitersegment, aufgrund eines steigenden strategischen Werts und da die Talsohle der Zyklizität erreicht ist.
- Ein erhöhtes Engagement im Bereich Hardware/Komponenten im ersten bis dritten Quartal aufgrund von KI-Trends und Gewinnmitnahmen im vierten Quartal.
- Ein erhöhtes Engagement bei Industriewerten aufgrund der soliden Aussichten in den Bereichen Automatisierung und erneuerbare Energien.
- Eine deutliche Reduzierung des Engagements in China und Umschichtung nach Indien und Südkorea.
- Wir nahmen die Gewinne des Engagements in Taiwan in der zweiten Jahreshälfte nach einer starken Performance mit.

Während das Ende des Zinserhöhungszyklus in Sicht ist, könnte die makroökonomische Unsicherheit anhalten. Wir setzen daher weiterhin auf Qualität, sind aber durchaus bereit, taktische Gelegenheiten zu nutzen und uns für zyklisches Wachstum zu positionieren. Wir sind in Bezug auf die Wachstumschancen in Asien optimistisch, vor allem bei modernsten Halbleitern, durch strukturelles Wachstum in KI, robuste Investitionsausgaben bei 5G und Datenzentren sowie die starke Zunahme Lifestyle-bezogener digitaler Inhalte.

Japan Equity Engagement – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse JPY I 20,17 %. Der MSCI Japan Small Cap Index (Net) (Total Return, JPY) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 21,09 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Japanische Aktien verzeichneten in der ersten Jahreshälfte positive Zuflüsse ausländischer Anleger, da sich die makroökonomischen Fundamentaldaten, unterlegt von steigenden Löhnen und Verbraucherpreisen verbesserten, was auf ein baldiges Ende der jahrelangen Deflation hindeutet.
- In der zweiten Jahreshälfte verlor die Rally am japanischen Aktienmarkt an Fahrt, da die globalen Anleger spekulierten, dass die Bank of Japan (BOJ) ihre ultralockere Geldpolitik früher als erwartet anpassen könnte.
- Im vierten Quartal verzeichnete der japanische Markt für Small- und Mid-Caps (SMID), angeführt von Qualitäts- und Wachstumsunternehmen, positive Anlegerzuflüsse. Der Hintergrund war, dass die Märkte damit begannen, die Aussicht auf Zinssenkungen durch die Federal Reserve einzupreisen, während die BOJ ihre Geldpolitik unverändert beließ.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
    - Die Einzeltitelauswahl innerhalb der Kernbestände in den Sektoren Immobilien und Finanzwerte.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
    - Die Einzeltitelauswahl unter den Kernbeständen im Nicht-Basiskonsumgütersektor.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Obwohl der Finanz- und der Immobiliensektor aufgrund der Erwartung der weltweiten Anleger, dass die BOJ mit der Normalisierung ihrer Geldpolitik beginnen würde, einer erheblichen Volatilität ausgesetzt waren, waren wir weiterhin bei jenen Kernbeständen strategisch positioniert, die sowohl Wachstumspotenzial besitzen als auch Aussichten auf eine Steigerung der Kapitaleffizienz haben.
- Außerdem setzten wir unsere konstruktiven Dialoge mit wichtigen Holdinggesellschaften in den Sektoren Kommunikation und Industrie fort, was zu neuen Engagements führte.
- Unsere Beteiligungen im Sektor Nicht-Basiskonsumgüter bei Emittenten mit einem Engagement in China hatten aufgrund der verzögerten makroökonomischen Erholung ein schwieriges Jahr. Wir halten diese Unternehmen weiterhin für führend in ihren jeweiligen Branchen und werden danach streben, unsere Positionen erneut aufzubauen, sobald wir festgestellt haben, dass sich die Abwärtsrisiken in ihren Bewertungen niedergeschlagen.

Wir erwarten, dass wir von der japanischen Wirtschaft gegenüber dem Rest der Welt, wo die Aussichten weiterhin unsicher sind, Widerstandsfähigkeit sehen werden. Wir glauben, dass der japanische Yen eine graduelle Aufwertung erfahren könnte, da die BOJ eine Normalisierung der Geldpolitik anstrebt, während sich die Zentralbanken weltweit auf Zinssenkungen vorbereiten. Vor diesem Hintergrund sind wir der Ansicht, dass das Marktumfeld für aktives Stock-Picking auf dem unterbewerteten japanischen SMID-Markt günstiger sein wird. Die Unternehmen generieren größere Umsätze auf dem Heimatmarkt und versuchen, die Kapitaleffizienz durch Bilanzreformen zu verbessern, was ein wichtiges Ziel unserer Gespräche mit den Managementteams ist.

Macro Opportunities FX – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 3,25 %. Der als Benchmark dienende ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 2,46 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse
Im Jahr 2023 bewegten sich die meisten wichtigen Währungen in relativ engen Bandbreiten. Der US-Dollar wurde über weite Strecken des Jahres auf einem starken Niveau gehandelt und profitierte davon, dass er eine der renditestärksten G10-Währungen ist und die US-Wirtschaft Outperformance verzeichnet. Als sich gegen Ende des Jahres die Daten abschwächten, richtete sich die Aufmerksamkeit auf die Erwartung, dass die US-Notenbank ihre Geldpolitik im Jahr 2024 deutlich lockern müsste, und der Dollar gab nach. Der japanische Yen war die schwächste der großen Währungen, denn die Bank of Japan hielt die Leitzinsen weiterhin bei 0 %, was die Kosten für das Halten des Yen gegenüber anderen Hauptwährungen verteuerte.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Übergewichtungen des australischen Dollars und des neuseeländischen Dollars trugen am meisten zur Performance bei
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Eine Untergewichtung der schwedischen Krone
  - Der japanische Yen

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Strategie verfolgte über das gesamte Jahr 2023 hinweg einen eher taktischen Handelsansatz.

Mit Blick auf das Jahr 2024 wird viel davon abhängen, ob die geldpolitische Lockerung einsetzen und welchen Umfang sie haben wird. Sollte dies nicht der Fall sein, würden wir erwarten, dass die Währungen weiterhin in engen Bandbreiten gehandelt werden.

Multi-Asset Income* – Bericht des Investment-Managers

Für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Portfolios am 6. Juli 2023 betrug die Gesamtrendite für die Thesaurierende Klasse USD I 2,95 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Obwohl die Zentralbank die geldpolitischen Zügel weiter anzog und eine Regionalbankenkrise einsetzte, zeigten sich die Wirtschaftsdaten robust. Das Wachstum ließ zwar nach, übertraf im Großen und Ganzen aber die Erwartungen. Die Inflation fiel von den erreichten Höchstwerten zurück, die Arbeitslosigkeit blieb niedrig und der Konsum rege.
- Am besten entwickelten sich die Aktienmärkte, angeführt von Megacap-Growth-Werten, beflügelt durch überschüssige Liquidität, Kapitalströme und Optimismus bezüglich KI und ihrer Auswirkungen.
- In den meisten Industrieländern gaben die Inflationswerte nach, was vor allem vorteilhaften Basiseffekten durch den Rückgang der Ölpreise von ihrem im Juni 2022 erreichten Hoch zuzuschreiben war, wenngleich die Kernraten hartnäckiger blieben. Im Vereinigten Königreich zogen die Löhne und die Preise für Kerndienstleistungen schneller an, was die Bank of England zu einem restriktiveren Vorgehen veranlasste.
- Die globalen Anleiherenditen erhöhten sich am kurzen Ende der Kurve. Das hatte in vielen Industrieländern eine stärkere Inversion der Renditekurve zur Folge. Unternehmensanleihen entwickelten sich gut, da sich die Spreads verengten. Titel mit niedrigerem Rating schnitten am besten ab, weil die Rezessionsgefahr auf kürzere Sicht zurückging.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Auf hohe laufende Erträge ausgerichtete Strategien lieferten einen soliden Positivbeitrag zur Rendite, an dem sowohl Aktien- als auch Festzinskomponenten Anteil hatten. Auch die Optionsstrategie steigerte den Ertrag kräftig, da die Volatilität auf den Aktienmärkten abnahm.
  - Im Aktiensegment kam der größte Wertbeitrag von dividendenstarken Titeln aus Industrieländern, gefolgt von Aktien aus Schwellenländern („EM").
  - Im festverzinslichen Bereich entwickelten sich europäische Hochzinsanleihen am besten. Dem lag eine Verengung der Spreads zugrunde. Auch Long-Strategien für Unternehmens-, Staats- und EM-Anleihen wirkten ausnahmslos ertragssteigernd.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Die Komponente der unkorrelierten Strategien wies im Berichtszeitraum ein Minus aus, da taktische und strategische Anpassungen belastend wirkten. Das war auf Einschätzungen zu Short-Positionen in Aktien und Long-Positionen im japanischen Yen zurückzuführen.
  - Im Aktiensegment minderte die Allokation in alternative Aktienstrategien die Performance, da sowohl die Sparte börsennotierte Infrastruktur als auch REITs unterdurchschnittlich abschnitten.
  - Im festverzinslichen Segment entwickelte sich die Allokation in Vorzugspapiere am schwächsten, da Bankenstress den Finanzsektor überschattete, wovon insbesondere hybride Wertpapiere in Mitleidenschaft gezogen wurden.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb breit gestreut über auf hohe laufende Erträge ausgerichtete Strategien, festverzinsliche Wertpapiere, hohe laufende Erträge abwerfende und alternative Aktien, Optionserträge und unkorrelierte Strategien.
- Im Berichtszeitraum wurde das Portfolio durch die Rückführung des Engagements in Staatsanleihen und REITs und den Ausbau der EM-Aktienstrategie neu gewichtet.
- Gemäß der am 6. Juni 2023 herausgegebenen Mitteilung an die Anteilinhaber begann das Portfoliomanagementteam am 20. Juni 2023 damit, im Vorfeld der Schließung des Portfolios am 6. Juli 2023 Positionen zu veräußern.

*Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Next Generation Mobility – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 29,43 %. Der MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 22,20 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die weltweiten Aktienwerte erholten sich im Laufe des Jahres 2023 stark und legten kräftig zu. Die Inflationswerte, die während des größten Teils der Zeit nach COVID erhöht waren, begannen sich im Laufe des Jahres 2023 abzukühlen. Die Renditen stiegen im Laufe des Jahres allgemein an, gaben jedoch gegen Ende des vierten Quartals deutlich nach, da die Straffungszyklen der Federal Reserve (Fed) zu einem Ende kommen und Zinssenkungen möglich sind.
- Vor diesem Hintergrund erzielten wachstumsorientierte Aktien wie die des IT-Sektors und Mega-Cap-Wachstumstitel im Allgemeinen eine Outperformance.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Engagement im IT-Sektor lieferte im Berichtszeitraum den größten Positivbeitrag zur relativen Wertentwicklung. Sektoren ohne Allokation wie Basiskonsumgüter, Energie, Gesundheitswesen und Versorger verzeichneten eine Underperformance, was sich auf die relative Performance positiv auswirkte.
  - Geografisch gesehen trug das US-amerikanische Engagement am meisten zur relativen Performance bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Engagement im Werkstoffsektor schmälerte die relative Wertentwicklung am meisten.
  - Geografisch gesehen war das Engagement in China für die größte Beeinträchtigung der Wertentwicklung verantwortlich.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Während des Berichtszeitraums wurden vier neue Positionen in das Portfolio aufgenommen: Albemarle, LG Energy, BYD und LG Chemical. Zwei Positionen wurden aus dem Portfolio entfernt: Coherent und Chargepoint.

Wir erwarten, dass das makroökonomische Umfeld unbeständig bleiben wird, weil die Zentralbanken versuchen, die Inflation wieder auf das angestrebte Niveau zu bringen und gleichzeitig das Wirtschaftswachstum zu stützen. Obwohl die verzögerten Folgen einer restriktiveren Geldpolitik wahrscheinlich zu einem langsameren Wirtschaftswachstum führen werden, könnte die sich abschwächende Inflation einigen Zentralbanken die Gelegenheit geben, mit Zinssenkungen zu beginnen. Die tragenden Säulen des Themas „Next Generation Mobility" bleiben unterdessen intakt. Wir rechnen mit weiteren Zuwächsen bei der Markterschließung und solidem Wachstum sowohl bei autonomen als auch bei strombetriebenen Fahrzeugen. Dem liegt neben anderen Faktoren auch die politische Förderung auf regionaler Ebene zugrunde. Wir behalten unseren Fokus auf hochwertigen, fundamental attraktiven Unternehmen bei, die wichtige Wegbereiter und Nutznießer dieses langfristigen Themas sind.

Next Generation Space Economy – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 27,26 %. Der als Benchmark dienende MSCI All-Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum ein Plus von 22,20 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse
Als sich das Jahr 2023 seinem Ende zuneigte, zeigte sich die Weltwirtschaft widerstandsfähig, und die Aktienmärkte erlebten ein wieder erstarktes Interesse. Die wichtigsten Indizes erlebten ein Comeback und machten die Rückgänge vom Vorjahr wett. Dabei stand der Technologiesektor im Rampenlicht, wobei KI-zentrierte Unternehmen und Halbleiterwerte die Nase vorn hatten. Dies ging in erster Linie auf den Enthusiasmus der Anleger sowie eine Rally am Telekommunikationsmarkt zurück. Im Gegensatz dazu hatten die traditionelleren defensiven Bereiche des Marktes wie Versorger, Energie und Gesundheitswesen Mühe, das Tempo zu halten, und sie blieben im Verlauf des Jahres zurück.

Die Märkte sahen während des Jahres außerdem erneute und verschärfte geopolitische Spannungen, die sich auf die gesamte Weltwirtschaft auswirkten: Russland/Ukraine, Israel/Hamas und USA/China trugen allesamt dazu bei, die Stimmung der Anleger noch komplexer zu machen. Zusätzlich zu dieser Dynamik rückte die Politik der Zentralbanken in den Mittelpunkt der Aufmerksamkeit, als die Länder sich darum bemühten, die hohe Inflation einzudämmen. Diese Zinserhöhungen führten zunächst zu einem vorsichtigen Ausblick und der Angst vor einer harten Landung. Gegen Ende des Jahres trugen die Erwartung auf bevorstehende Zinssenkungen durch die US-Notenbank und ein mehr abgeschwächtes Arbeitsmarktumfeld dazu bei, dass sich Aktien in den letzten beiden Monaten des Jahres erholten und sich ein positiverer Ausblick für Aktien im Jahr 2024 herauskristallisierte.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die starke Einzeltitelauswahl im Industriesektor, insbesondere in Luft- und Raumfahrt/Verteidigung.
  - Eine strukturelle Untergewichtung thematisch weniger relevanter Sektoren (z. B. Gesundheitswesen), die während des Jahres einen Rückstand verzeichneten.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl und die Untergewichtung im Sektor Kommunikationsdienste (fehlendes Engagement in Mega-Cap-Technologiewerten wie META Platforms und Google).
  - Der leichte „Cash-Drag" durch die opportunistische Verwendung von Kapital nach Zuflüssen aufgrund von Markt-Rallys.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio verfolgte weiterhin einen Hantel-Ansatz zwischen wachstumsorientierten und defensiven Positionen. Wir nutzten wir Verzerrungen als Chance, fundamental und thematisch relevante Positionen einzugehen und hochzuskalieren.
- Eine größere Zahl von Wertpapieren im Portfolio war auf die zunehmenden Multi-Sektor-Anlagegelegenheiten ausgerichtet und trug zur Risikostreuung bei.

Im Jahr 2023 wurden wir Zeuge einer Vielzahl von Fortschritten und Ankündigungen innerhalb des Ökosystems Weltraum, die sich auf eine Vielzahl von Branchen, Unternehmen und Nationen auswirkten. Die Weltraumwirtschaft verzeichnete eine bemerkenswerte Diversifizierung in den Bereich der Telekommunikation hinein. Wir sahen die Einführung von Satelliten-zu-Telefon-Diensten, Versicherungen wie die Swiss-Re, die die Weltraumtechnologie für Risiko- und Wetteranalysen nutzten, und im Bereich der Landwirtschaft kündigte John Deere eine Ausschreibung für Satelliten an, um seine Traktoren weltweit zu vernetzen. Darüber hinaus wurde die Schubkraft des sogenannten „Weltraumwettlaufs 2.0" deutlich, als Indien im Juli als viertes Land eine Mondlandung bewerkstelligte und in Japan einige neue raumfahrtorientierte Unternehmen an die Börse gingen. Dieser Enthusiasmus ist Beleg für die wachsenden Ertragsströme in diesem Sektor, die durch eine robuste Nachfrage, verbesserte Fähigkeiten und die Ausweitung der Endmärkte angetrieben werden. Unsere Anlagestrategie konzentriert sich weiterhin auf fundamental starke Ideen, die mit dem Thema Raumfahrt verbunden sind. Wir sind zuversichtlich, dass das Portfolio strategisch positioniert ist, um von der erwarteten Expansion zu profitieren.

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

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 6,45 %. Der als Benchmark dienende JPM Asia Hard Currency Index (Total Return, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 7,02 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Jahr 2023 war durch eine hohe Zinsvolatilität gekennzeichnet. Diese war durch die anhaltenden Zinserhöhungen der US-Notenbank, den sich während des Jahres einstellenden Verlusts der wirtschaftlichen Dynamik in China sowie die erhöhte Unsicherheit über den Verlauf des künftigen Wachstums in der gesamten Region bedingt.
- Die Anlageklasse Asia Debt Hard Currency zeigte sich im Laufe des Jahres bei den Fundamentaldaten widerstandsfähig. Technische Faktoren spielten bei der Unterstützung der Anlageklasse ebenfalls eine wichtige Rolle, da die Nettoemissionen in US-Dollar einen historischen Tiefstand erreichten.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Auf Länderebene trugen vor allem Sri Lanka, Indien, Südkorea und Indonesien zu einer positiven relativen Rendite bei.
  - Zu den besten Übergewichtungen, die im Vergleich zum Index einen positiven Wertbeitrag leisteten, gehörten die Sektoren Finanzen, Versorger und Industrie.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Performance wurde im Laufe des Jahres vor allem durch die Allokation des Portfolios zu China beeinträchtigt, eine Folge der anhaltenden Volatilität im Hochzins-Immobiliensektor.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Während des Berichtszeitraums erhöhte das Portfolio sein Engagement unter anderem in Südkorea, Singapur und Sri Lanka.
- Trotz teilweiser Gewinnmitnahmen bei Staatsanleihen aus Sri Lanka behielten wir eine insgesamt übergewichtete Position bei.
- Das Portfolio verringerte im Berichtszeitraum sein Engagement unter anderem in China, Hongkong und Macao.

Mit Blick auf die Zukunft gehen wir davon aus, dass die Schuldtitel der asiatischen Schwellenländer durch ein langsameres, aber nicht rezessives US-Wachstum, niedrigere globale Renditen und einen allgemein größeren Wachstumsvorsprung der Schwellenländer gegenüber den Industrieländern unterstützt werden. Die relativ schwache Nachfrageerholung in China, Deflationssorgen und der strukturelle Gegenwind für die Wirtschaft werfen weiterhin Fragen auf. Was den Rest der Region angeht, so sehen wir weiterhin eine strukturelle Stärkung der makroökonomischen Fundamentaldaten Indiens und Indonesiens, wie beispielsweise eine robustere Außenhandelsbilanz. Was die Ausfälle angeht, glauben wir, dass sie in Asien außerhalb Chinas niedrig bleiben werden und sich der Schwerpunkt weiterhin auf den Immobiliensektor in Chinas Hochzinssegment konzentrieren wird. Außerhalb Chinas sehen wir vor allem in Süd- und Südostasien, einschließlich Indien, Anlagechancen. Die Fundamentaldaten und Bewertungen sind hier attraktiv, insbesondere im Bereich der erneuerbaren Energien.

Short Duration Emerging Market Debt – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 8,06 %. Der ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte während des gleichen Zeitraums 5,01 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktstimmung wurde in erster Linie von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt. Die Renditen auf 2-jährige US-Staatsanleihen waren sehr volatil und stiegen auf weit über 5 % an, bevor sie im letzten Quartal stark zurückgingen und, inmitten von Anzeichen, dass der Zinserhöhungszyklus der Fed beendet war, das Jahr wenig verändert bei 4,25 % beendeten.
- In Verzug geratenen Schwellenländer erzielten weitere Fortschritte bei den Umstrukturierungsvereinbarungen mit offiziellen und privaten Gläubigern.
- Die Spreads für EM-Staatsanleihen verengten sich im Schnitt von 384 Bp auf 453 Bp mit einem Höchststand von 510 Bp im März etwa zu der Zeit, als in den USA und Europa die Bankenkrise einsetzte. Auch die Spreads von EM-Unternehmensanleihen verengten sich von 273 auf 308 Bp.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Beteiligungen an Staatsanleihen aus El Salvador leisteten aufgrund der guten Haushaltslage den größten Beitrag zur Performance, gefolgt von unseren Staatsanleihen in Sri Lanka, Argentinien und Kolumbien.
  - In Bezug auf Unternehmensanleihen trugen vor allem Positionen in den Sektoren Bergbau und erneuerbare Energien in Indien sowie Beteiligungen in den Sektoren Energie und Banken in Kolumbien bei.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Engagement bei Staatsanleihen in Ecuador sorgte für die meisten Abzüge von der Wertentwicklung, da die Anleihen aufgrund der zunehmenden politischen Risiken unter Druck standen.
  - Die Positionierungen bei Unternehmensanleihen im brasilianischen Industriesektor war der andere große Negativfaktor in diesem Zeitraum.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio blieb bei einer ausgewogenen Allokation in EM-Unternehmensanleihen und staatlichen/quasistaatlichen Emissionen und einer Duration von knapp 2 Jahren.
- Wir bauten unser Engagement bei hochwertigen Emittenten aus Südkorea in allen Sektoren über den Primärmarkt ebenso aus wie bei Emittenten mit einem BB-Rating, bei denen wir eine Verbesserung der Fundamentaldaten ihrer Anleihen sehen, darunter Kolumbien und Serbien.
- In China reduzierten wir angesichts der knappen Bewertungen verschiedener Namen und des anhaltenden Gegenwinds für den Immobiliensektor unser Engagement. Ebenfalls reduziert haben wir das Engagement in Katar und Oman, da sich die Spreads verengt haben.

Wir gehen davon aus, dass die Anlageklasse der EM-Anleihen 2024 von einem Umfeld mit einem langsameren aber nicht rezessivem US-Wachstum, niedrigeren globalen Renditen und einem zunehmenden Wachstumsvorsprung für Schwellenländer gegenüber den Industrieländern unterstützt werden wird. Wir sehen ein für dieses Jahr begrenztes Risiko für Ausfälle von EM-Staatsanleihen, und das verstärkte Engagement des Internationalen Währungsfonds (IWF) in verschiedenen Schwellenländern sollte deren Finanzierungsbedarf und die Reformagenda unterstützen. Bei den hochverzinslichen EM-Unternehmensanleihen sehen wir ebenfalls sinkende Ausfallrisiken, wobei erwartet wird, dass die Ausfallraten von 7,8 % im letzten Jahr auf 4,8% im Jahr 2024 fallen dürften. Während die Bewertungen in Teilen der Anlageklasse, z. B. bei verschiedenen Staatsanleihen mit Investment Grade, relativ teuer geworden sind, sehen wir bei diversen Emittenten weiterhin Gelegenheiten für Spread-Verengungen, insbesondere im Hochzinssegment. Die Hauptrisiken für unsere konstruktive Sichtweise sind entweder eine unerwartete Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erfordern würde, oder eine tiefe globale Rezession, die die EM-Risikoprämien erheblich in die Höhe treiben würde.

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

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 9,93 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt für Hochzinsanleihen beendete den Berichtszeitraum mit starken Renditen, die von der Risikobereitschaft gegen Jahresende angetrieben wurden, als die Spreads zurückgingen und die Märkte für 2024 trotz robuster Wirtschaftsdaten Zinssenkungen einpreisten. Für das Kalenderjahr 2023 waren die Renditen von Hochzinsanleihen die höchsten seit 2019.
- Die aggregierten Fundamentaldaten von Hochzinsemittenten in Bezug auf das Wachstum des Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibungen, der freie Cashflow, die Zinsdeckung und der Verschuldungsgrad, hielten sich in einem recht günstigen Bereich, und die Ertragssaison fiel im Großen und Ganzen besser aus als befürchtet. Die Aussichten in Bezug auf Zahlungsausfälle bleiben ebenfalls relativ günstig.
- Zwar ist die Ausfallquote von ihren Tiefstständen im Jahr 2022 gestiegen, doch erwarten wir, dass die Ausfallquoten in 2024 in einem Bereich knapp unter dem langfristigen Durchschnitt bleiben werden. Dieser Ausblick stützt sich auf unsere Bottom-up-Beurteilung von Emittenten und wird getragen von dem qualitativ höherwertigen Ratingsmix im Hochzinssegment (48 % der Emittenten mit Kreditratings von BB), von weniger aggressiven Neuemissionen, weniger kurzfristigen Fälligkeiten sowie einem Energiesektor, der deutlich solider ist als in den letzten Zyklen.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Aus sektoraler Sicht die Positionierungen im Sektor Midstream-Energie, im Werkstoffsektor und bei Kabel/Satelliten.
  - Aus der Perspektive der Ratings die Positionierungen bei Emittenten mit den Ratings B, BB, CCC und BBB.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Aus Sektorsicht die Positionierungen in den Bereichen Sonstige Industrie sowie Glücksspiel und Beherbergung.
  - Aus Ratingperspektive gab es keine Wertabzüge.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Rahmen unserer Hochzinsstrategien haben wir selektiv in qualitativ höherwertige BB-Anleihen umgeschichtet, wo die Preise im Verhältnis zu den zugrunde liegenden Fundamentaldaten attraktiv blieben und die Ausfallerwartungen niedrig waren.
- Bei den CCC-Positionierungen haben wir eine differenzierte Sicht auf die einzelnen Unternehmensanleihen, die auf unseren hausinternen Ratings und den Einschätzungen der Analysten zu den einzelnen Krediten beruht. Zudem konzentrierten wir uns auf Umschichtungen innerhalb von Branchen und Risikokategorien des Marktes, um die Widerstandsfähigkeit gegenüber Inflations- und Lohnkostentrends zu maximieren, sofern diese fortbestehen. Außerdem haben wir das Verschuldungsprofil des Portfolios, wo dies ohne Verluste möglich war, heruntergefahren.
- Unser Plan war es, das Portfolio in erster Linie auf BB- und höherwertige B-Kreditrisiken zu konzentrieren (auf Basis unseren internen Kreditratings) und Sektoren überzugewichten, die wir im aktuellen Umfeld als widerstandsfähig einschätzen.

Wir sind der Meinung, dass die Bewertungen von Hochzinsanleihen eine mehr als angemessene Entschädigung für die mehr oder weniger durchschnittlichen Ausfallerwartungen darstellen, die Anleihen weiterhin dauerhafte Erträge bieten und im Vergleich zu anderen festverzinslichen Alternativen attraktiv sind. Da die Kreditstreuung zugenommen hat, konzentrieren sich unsere Analysten auf die spezifischen Fundamentaldaten individueller Emittenten und bewerten die Basis- und Abwärtsszenarien im Falle einer weichen Landung oder Rezession. Trotz potenzieller kurzfristiger Volatilität, die sich aus der Unsicherheit in Bezug auf das Wirtschaftswachstum ergibt, sind wir der Meinung, dass wir mit unserem fundamentalen Bottom-up-Kreditresearch – mit Konzentration auf die Auswahl von Wertpapieren, die Vermeidung von Bonitätsherabstufungen und die ausschließliche Aufnahme der „besten Ideen" in die Portfolios – gut aufgestellt sind, um von eventueller Volatilität zu profitieren.

Strategic Income – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 8,88 %. Der als Benchmark dienende Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 5,53 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- In dem Bemühen, die Inflation zu bekämpfen, setzten die Zentralbanken der Industrieländer ihren Zinserhöhungszyklus fort. Die Federal Reserve hob die Leitzinsen um 100 Basispunkte (Bp) an.
- Die Zinsvolatilität war während des gesamten Berichtszeitraums hoch. Im November und Dezember, als die Inflation im Griff zu sein schien und eine Verlangsamung des Wachstums erwartet wurde, preiste der Markt zunehmend aggressive Zinssenkungen in der nahen Zukunft ein. Dies trug zu einer erheblichen Rally bei Staatsanleihen und Aktien bei.
- Die Kreditspreads verengten sich im Berichtszeitraum, was auf eine besser als erwartete Wirtschaftsleistung und eine stetige Nachfrage nach Unternehmensanleihen zurückzuführen ist. Die Kreditspreads für US-amerikanische Unternehmensanleihen mit und ohne Investment Grade (IG) verengten sich um 28 Bp bzw. 144 Bp.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Allokationen zu US-amerikanischen und europäischen Hochzinsanleihen, Kreditrisikotransfers von Collateralised Loan Obligations (CLO), Schwellenländeranleihen, inflationsgeschützten US-Staatsanleihen und Kommunalobligationen.
  - Die Einzeltitelauswahl bei globalen IG-Unternehmensanleihen und quasistaatlichen Mortgage Backed Securities (MBS).
  - Die Untergewichtung der Duration im Portfolio.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtung von IG-Unternehmensanleihen.
  - Die Allokation zu in hybriden Finanztiteln.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Hinsichtlich der Portfolioadjustierung haben wir im Laufe des Jahres das Engagement in US-Hochzinstiteln, nominalen US-Staatsanleihen und IG-Unternehmensanleihen reduziert.
- Wir erhöhten das Engagement bei quasistaatlichen MBS, CLO-Schuldtiteln und europäischen Hochzinsanleihen.
- Auf der Kernebene reduzierten wir die Portfolioduration um etwa eineinhalb Jahre.

Angesichts der sich verbessernden Inflationstendenzen und dem Umstand, dass die Zinssätze der Zentralbanken wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, sind wir der Auffassung, dass das wirtschaftliche Wachstum immer wichtiger für die Renditen festverzinslicher Wertpapiere wird. Wir bevorzugen das Halten von festverzinslichen Wertpapieren mit einer Laufzeit von bis zu fünf Jahren, um die noch immer hohen Zinsen zu sichern, bevor sie wieder sinken. Wir erwarten, dass sich die Zweiteilung der Kreditmärkte zugunsten von Qualität fortsetzen wird. Insgesamt glauben wir, dass 2024 eine lohnende Zeit für solche globale Anleiheinvestoren sein könnte, die sich beim Aufbau ihrer Portfolios auf Fundamentaldaten und Selektivität konzentrieren.

Sustainable Asia High Yield – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 2,04 %. Der als Benchmark dienende JPMorgan ESG Asia Credit (JSEC JACI) – High Yield Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 4,07 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Jahr 2023 war durch eine hohe Zinsvolatilität gekennzeichnet. Diese war durch die anhaltenden Zinserhöhungen der US-Notenbank, den sich während des Jahres einstellenden Verlusts der wirtschaftlichen Dynamik in China sowie die erhöhte Unsicherheit über den Verlauf des künftigen Wachstums in der gesamten Region bedingt.
- Die asiatischen Märkte für hochverzinsliche Unternehmensanleihen erzielten im Jahresverlauf insgesamt positive Renditen, und viele Sektoren zeigten eine grundsätzliche Widerstandsfähigkeit. Bestimmte Sektoren waren allerdings weiterhin von einer hohen Volatilität geprägt, insbesondere der chinesische Hochzins-Immobiliensektor.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Auf Länderebene trugen vor allem Sri Lanka, Macau, Malaysia und Indien zu einer positiven relativen Rendite bei.
  - Zu den wichtigsten Übergewichtungen, die im Vergleich zum Index einen positiven Wertbeitrag leisteten, gehörten die Sektoren Telekommunikation, Metalle & Bergbau sowie Konsumgüter.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Performance wurde im Laufe des Jahres vor allem durch die Allokation des Portfolios zu chinesischen Immobilien beeinträchtigt, eine Folge der anhaltenden Volatilität im Hochzins-Immobiliensektor.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Während des Berichtszeitraums erhöhte das Portfolio sein Engagement unter anderem in Südkorea, Macau und den Philippinen.
- Das Portfolio verringerte das Engagement u. a. in Hongkong, Singapur und China.

Mit Blick auf die Zukunft gehen wir davon aus, dass die Schuldtitel der asiatischen Schwellenländer durch ein langsameres, aber nicht rezessives US-Wachstum, niedrigere globale Renditen und einen allgemein größeren Wachstumsvorsprung der Schwellenländer gegenüber den Industrieländern unterstützt werden. Die relativ schwache Nachfrageerholung in China, Deflationssorgen und der strukturelle Gegenwind für die Wirtschaft werfen weiterhin Fragen auf. Was den Rest der Region angeht, so sehen wir weiterhin eine strukturelle Stärkung der makroökonomischen Fundamentaldaten Indiens und Indonesiens, wie beispielsweise eine robustere Außenhandelsbilanz. Was die Ausfälle angeht, glauben wir, dass sie in Asien außerhalb Chinas niedrig bleiben werden und sich der Schwerpunkt weiterhin auf den Immobiliensektor in Chinas Hochzinssegment konzentrieren wird. Außerhalb Chinas sehen wir vor allem in Süd- und Südostasien, einschließlich Indien, Anlagechancen. Die Fundamentaldaten und Bewertungen sind hier attraktiv, insbesondere im Bereich der erneuerbaren Energien.

Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 7,88 %. Der als Benchmark dienende JPMorgan JESG CEMBI Broad Diversified Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 9,22 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die Marktstimmung wurde generell von Entwicklungen im Zusammenhang mit Inflation und Geldpolitik geprägt, da sich die Erwartungen hinsichtlich etwaiger Maßnahmen der US-Notenbank auf Grundlage der wirtschaftlichen Daten von der ersten auf die zweite Jahreshälfte verschoben.
- Die Wiederöffnung Chinas war im Frühjahr ein Thema, das Unterstützung bot. Gleichzeitig machten ausgefallene Titel Fortschritte bei Umschuldungsvereinbarungen mit öffentlichen und privaten Gläubigern.
- Die Spreads für nachhaltige Unternehmensanleihen aus Schwellenländern („EM") verengten sich von 323 Basispunkten (Bp) auf 284 Bp mit einem Höchststand von 386 Bp im März. Die Ukraine war im Berichtszeitraum der Markt mit der besten Performance, gefolgt von Irak und Ghana. Am anderen Ende der Skala schnitten Polen und China mit negativen Renditen am schlechtesten ab.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung von Argentinien nach den Präsidentschaftswahlen und die Einzeltitelauswahl bei saudi-arabischen Versorgern.
  - Die Übergewichtung von indischen Unternehmen im Bereich der erneuerbaren Energien.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung des Engagements in China, das im Laufe des Jahres aufgrund des sich verlangsamenden Wachstums und der anhaltenden Schwäche des Immobilienmarktes eine Underperformance verbuchte.
  - Die Untergewichtung in der Ukraine, wo es im Unternehmensbereich einige Verbesserungen gab.
  - Die Positionierungen bei brasilianischen Chemieunternehmen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir begannen das Jahr mit einer Übergewichtung von Hochzins-Unternehmensanleihen. Im Laufe des Jahres verringerten wir unser Engagement im Bereich der BB-Ratings und stockten unseren Korb mit AA-Papieren auf.
- Nach Sektoren aufgeschlüsselt, erhöhten wir unser Engagement bei Emittenten aus dem Bereich Öl & Gas. Wir waren außerdem im Finanzsektor aktiv und beendeten das Jahr hier mit einer höheren Gesamtgewichtung. Wir verringerten unser Engagement im Sektor Metalle & Bergbau, da die Preise hier und insbesondere für Eisenerz allgemein zurückgingen. Wir verringerten zudem unser Engagement im Telekommunikationssektor, wo einige Emittenten unter Druck gerieten.
- Nach Ländern aufgeschlüsselt erhöhten wir unser Engagement in der Türkei, da die geldpolitischen Entscheidungsträger zu einer mehr orthodoxen Politik zurückkehrten, in den Vereinigten Arabischen Emiraten, wo Neuemissionen attraktive Prämien boten und wir den Ausblick für den Finanzsektor als positiv einschätzen, und in Argentinien, wo eine neue Regierung die Emittenten von Unternehmensanleihen unterstützt. Wir reduzierten unser Engagement in Südafrika, Katar, China und Brasilien.

Wir gehen davon aus, dass die Anlageklasse der EM-Anleihen in 2024 von einem Umfeld mit einem langsameren, aber nicht rezessiven US-Wachstum, niedrigeren globaler Renditen und einem zunehmenden Wachstumsvorsprung für Schwellenländer gegenüber den Industrieländern unterstützt werden wird. Wir sehen ein für dieses Jahr begrenztes Risiko für Ausfälle von EM-Staatsanleihen, und das verstärkte Engagement verschiedener Schwellenländer mit dem Internationalen Währungsfonds (IWF) dürfte den Finanzierungsbedarf und die Reformpläne unterstützen. Während die Bewertungen in Teilen der Anlageklasse, z. B. im Investment-Grade-Bereich, relativ teuer geworden sind, sehen wir bei diversen Emittenten weiterhin Gelegenheiten für Spread-Verengungen. Die Hauptrisiken für unsere konstruktive Sichtweise sind entweder eine unerwartete Beschleunigung der Inflationsdynamik weltweit, die deutlich mehr Zinserhöhungen erfordern würde, oder eine tiefe globale Rezession, die die EM-Risikoprämien erheblich in die Höhe treiben würde.

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

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 13,11 %. Der als Benchmark dienende JPMorgan ESG EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 10,26 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Jahr begann für die Schwellenländer positiv, da davon ausgegangen wurde, dass eine sanfte Landung und eine damit einhergehende Lockerung der Geldpolitik in den USA der Anlageklasse durch niedrigere Kreditkosten zugute kommen würde. Die Risikostimmung verschlechterte sich, als der Zusammenbruch der Silicon Valley Bank im März zu einigen der seit Jahrzehnten größten Bewegungen am Rentenmarkt führte.
- Ab dem Sommer führte dann die Aussicht auf für einen längeren Zeitraum höhere Zinsen zu einem großen Ausverkauf bei Anleihen, der die Renditen auf 10-jährige US-Staatsanleihen zum ersten Mal seit der globalen Finanzkrise kurzzeitig über 5 % klettern ließ. Der Markt begann ab Oktober erneut damit, das Szenario einer weichen Landung einzupreisen, und das Thema gewann im Dezember weiter an Dynamik, insbesondere nachdem die Fed eine Zinssenkung um 75 Basispunkte (Bp) für 2024 angekündigt hatte.
- Die geopolitischen Ereignisse blieben ebenfalls im Fokus, insbesondere nach dem Angriff der Hamas auf Israel im Oktober, während es unterdessen keine Lösung für den Krieg in der Ukraine gab.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Länderallokation zeichnet sich durch die Übergewichtung von Märkten mit höheren Renditen aus, insbesondere El Salvador, Argentinien und Sri Lanka. Sie erfüllen die ökologischen oder sozialen Ziele des Portfolios.
  - Die Einzeltitelauswahl über auf Euro lautende Anleihen Rumänien und Serbien.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Eine übergewichtete Allokation zu Ecuador, wo politische Herausforderungen den Druck auf die Finanzen verstärkten.
  - Die Untergewichtung der Türkei, wo die Regierung eine deutliche Kehrtwende vollzog und einer orthodoxen Politik zu folgen begann.
  - Die Einzeltitelauswahl in Ghana über die partielle Weltbankgarantie bis 2030.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio änderte seinen Rahmen für nachhaltige Staatsanleihen, indem es Messungen der biologischen Vielfalt und der Einkommensungleichheit sowie zusätzliche Gesundheitsindikatoren einbezog. Es ist das Ziel des Portfolios, 100 % seines Engagements bei Anleihen in nachhaltigen Anlagen zu halten.
- Das Portfolio hielt an einer Tendenz zu Hochzinstiteln (gegenüber Unternehmensanleihen mit Investment Grade) fest. Wir erhöhten unsere Übergewichtung von Argentinien in Erwartung positiver politischer Anpassungen nach den Wahlen sowie ebenso in Armenien, Kolumbien, El Salvador, und Serbien, wo wir eine Widerstandsfähigkeit gegenüber den strengeren globalen Finanzierungsbedingungen feststellen.
- Wir stockten unsere Übergewichtung in Polen auf und verkauften aufgrund geänderter Nachhaltigkeitsbewertungen Staatsanleihen aus Ecuador, Panama und den Vereinigten Arabischen Emiraten.

Wir gehen davon aus, dass die Anlageklasse der EM-Anleihen von einem Umfeld mit einem langsameren aber nicht rezessivem US-Wachstum, niedrigeren globalen Renditen und einem zunehmenden Wachstumsvorsprung für Schwellenländer gegenüber den Industrieländern im Jahr 2024 unterstützt werden wird. Wir sehen ein für dieses Jahr begrenztes Risiko für Ausfälle von Staatsanleihen, während das verstärkte Engagement des Internationalen Währungsfonds (IWF) in verschiedenen Schwellenländern den Finanzierungsbedarf und die Reformagenda unterstützen dürfte. Die technischen Daten der Anlageklasse haben sich verbessert, da die Anleger nach einer Periode mit Rekordabflüssen hier nur noch geringfügig positioniert und die Zahl der Nettoemissionen begrenzt sind. Wir sehen Chancen für eine Verengung der Spreads bei bestimmten Emittenten und Anleihen von außerhalb der Benchmark, insbesondere im BB-Ratingsegment.

Tactical Macro – Berichts des Investment-Managers

Für den Berichtszeitraum von seiner Auflegung am 30. Juni 2023 bis zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 2,20 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse.

- Globale Aktien und Anleihen verbuchten im Jahr 2023 eine starke Performance und trotzten damit den Erwartungen der meisten Anleger, die erwartet hatten, dass der globale Straffungszyklus die Wirtschaftstätigkeit belasten würde.
- Der Inflationsdruck ließ im Jahresverlauf nach, und die Zentralbanken gingen von einer aggressiven Rhetorik zu einer datenabhängigen Haltung über und stellten zum Jahresende die Weichen für Zinssenkungen im Jahr 2024.
- Während die Anleger durch ein unbeständiges, von regionalem Bankenstress sowie geopolitischen und politischen Spannungen geprägten Wirtschafts- und Investitionsumfeld navigierten, blieben die Unternehmensgewinne dank eines gut gestützten Verbraucher- und Arbeitsmarktes stabil.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Der Gesamtertrag des Portfolios ohne Barmittel bestand während des Berichtszeitraums aus S&P 500-Kaufoptionen, Short-Positionen bei 10-jährigen US-Staatsanleihen und eine Short-Position des Russell 2000.
- Negativbeiträge zur absoluten Rendite:
  - Short-Positionen bei japanische Staatsanleihen, eine Short-USD/JPY -Position und S&P-500-Risikoumkehroptionen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im dritten Quartal 2023 begannen wir damit, das Portfolio so zu positionieren, dass es durch sein Engagement entlang der Renditekurve und eine Short-Position bei US-Aktien eine Stagflationsperspektive in seiner Konstruktion einbettet. Zudem haben wir Long-Positionen im Euro und im japanischen Yen implementiert.
- Im vierten Quartal 2023 verlagerte sich unser Schwerpunkt vom Handel mit Qualitätsaktien auf einen breiter angelegten Ansatz. Aufgrund der veränderten Signale der Fed kam es bei Positionen mit Schwerpunkt auf Small-Caps und Aktien mit einer kurzen Duration zu einer Umkehr.
- Als wir uns dem Ende des Jahres 2023 näherten und sich ein zuversichtlicheres Marktszenario für eine weiche Landung einstellte, profitierte das Portfolio von einem kurzlaufenden SPX-Call. Außerdem implementierten wir Call-Spreads auf die Secured Overnight Financing Rate (SOFR), da wir der Ansicht waren, dass der Markt in seiner Preisgestaltung für den Zeitpunkt und das Ausmaß von Zinssenkungen zu prätentiös geworden war.

Mit Blick auf die Zukunft sind wir der Ansicht, dass der einzigartige Charakter dieses geldpolitischen Straffungszyklus Risikoanlagen unterstützt hat, doch müssen wir uns auch nach dem Ausstieg aus dem Straffungszyklus der großen Bandbreite der Ergebnisse bewusst sein, die sich im Jahr 2024 ergeben könnten. In unseren Augen ist es höchst ungewöhnlich, dass ein rascher Rückgang des nominalen BIP ohne eine gewisse Beeinträchtigung der Gewinnspannen und Erträge erfolgt. Dennoch sind die Konsensusprognosen für Aktienwerte in den letzten Monaten kontinuierlich gestiegen. Außerdem gibt es Zeiten, in denen es am Markt um Dynamik und Kapitalströme geht, und Zeiten, in denen man sehr genau darauf achten muss, was bereits eingepreist ist: Während eine auf Liquidität basierende Rally von hier aus durchaus möglich ist (sogar eine aggressive Rally), falls der Markt wirklich einen sich abzeichnenden Lockerungszyklus annimmt, haben wir bereits die größte Divergenz der Wahrscheinlichkeiten für eine weiche Landung – im Vergleich zu dem Stagflationsszenario seit Ende 2021 – eingepreist. In Anbetracht der Ausgangslage zu Beginn des Jahres werden wir ein gewisses Short-Engagement bei US-Aktien gegenüber japanischen Aktien sowie Long-Positionen in fünfjährigen US-Staatsanleihen aufbauen. Letztere wollen wir im Falle eines Renditeanstiegs im Zusammenhang mit der Sorge des Marktes über das Angebot von Neuemissionen aufstocken. Auch haben wir unsere Long-Position im JPY beibehalten. Wir sind nach wie vor der Meinung, dass der Markt recht unbeständig ist und dass die Wachstumsaussichten nach wie vor viel unsicherer sind als die Inflationsaussichten. Es wird interessant sein, zu sehen, wie sich dies bis 2024 auf Risikoanlagen auswirkt.

Ultra Short Term Euro Bond – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse EUR I 6,72 %. Der ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum 2,46 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividenden und sonstigen Ausschüttungen.)

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Eine volatile Inflation, robuste Wirtschaftsdaten und die Rhetorik der Zentralbanken erwiesen sich im Jahr 2023 als die wichtigsten Antriebskräfte für die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere. Die Finanzbedingungen haben sich über weite Strecken des Jahres verschärft, was zu einem Teil eine Folge der Bankenzusammenbrüche im ersten Quartal war, während der Mangel an Arbeitskräften unterdessen die Arbeitsmärkte angespannt hielt und die Verbraucherausgaben über den Erwartungen lagen. Im vierten Quartal änderte sich der Ton, wobei die unter den Erwartungen liegenden Inflationsdaten den Anlegern das Signal gaben, dass die Zentralbanken, einschließlich der Europäischen Zentralbank (EZB), nahe am oder auf dem Höchststand der Zinssätze waren. In Europa schlossen die Investment-Grade- und die Hochzinsmärkte mit einer Rendite von 8,84 % bzw. 12,81 % im positiven Bereich.
- Die Zinsmärkte waren in 2023 die Hauptquelle für die Volatilität der Rentenmärkte. Während das Jahr 2023 viele Phasen mit Volatilität aufwies (insbesondere im März und Oktober), wurden im letzten Quartal zahlreiche Inflationsziele verfehlt. Dies führte zu einer Rally an den Zinsmärkten, wo die Renditen zum Jahresende ungefähr auf demselben Niveau lagen wie zu Beginn des Jahres. Die wichtigsten Indizes verzeichneten die besten zwei Monate ihrer Geschichte, darunter der EUR Aggregate (6,14 %) und der Pan-European Aggregate (6,63 %).
- Die Spreads, von denen eine deutliche Ausweitung erwartet wurde, waren stabil (und verengten sich sogar), und die Ausfallraten blieben unter bzw.nahe dem historischen Durchschnitt.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Engagement bei Finanz- und Industriewerten (316 Bp bzw. 260 Bp).
  - Das Engagement bei zyklischen Konsumgütern nahm deutlich zu (70 Bp), da die Performance von Unternehmensanleihen im Jahr 2023 über den Erwartungen lag und die Fundamentaldaten intakt geblieben sind.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Der Einsatz von Derivaten (-52 Bp), die im Jahresverlauf eine dynamische Positionierung ermöglichten und zum Risikomanagement eingesetzt wurden, wirkte sich negativ aus.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Im Laufe des Jahres 2023 haben wir mehrere Handelsstrategien rückgängig gemacht, die wir im Jahr 2022 umgesetzt hatten. Dabei handelte es sich insbesondere um solche, bei denen wir das Kreditrisiko als Reaktion auf die erhebliche Spread-Ausweitung im dritten Quartal des Jahres erhöht hatten. Wir verringerten das Beta des Gesamtportfolios strategisch, indem wir in erster Linie unser Gewichtung von Unternehmensanleihen sowohl im Investment-Grade-Bereich als auch im Hochzinssegment reduzierten. Gleichzeitig profitierten wir von der inversen Renditekurve, indem wir mehr Mittel in gedeckte Anleihen mit kurzer Duration investierten.
- Im Hochzinssegment trennten wir uns von den in unseren Augen überteuerten Wertpapieren mit einem BB-Rating und stockten unsere Investitionen in REITs auf, um die in den Jahren 2022 und 2023 zu beobachtende erhebliche Spread-Ausweitung zu nutzen.

Zu Beginn des neuen Jahres sind wir in Anbetracht der unsicheren Wirtschaftsaussichten und des Risiko-/Ertragsprofils bei Spreads defensiv positioniert. Die Inflation hat zwar ihren Höhepunkt erreicht, doch werden die Daten im Laufe des Jahres zusammen mit der Gesundheitslage der breiteren europäischen Wirtschaft ausschlaggebend dafür sein, wie schnell die EZB die Zinsen senken kann. Insgesamt liegen die Renditen nach wie vor deutlich über den historischen Durchschnittswerten und wir denken, dass in dieser Anlageklasse immer noch Spielraum für hohe Renditen im Jahr 2024 besteht. Angesichts der Wahlen in den USA, Großbritannien und Europa sowie der anhaltenden geopolitischen Spannungen wird die Volatilität im Jahresverlauf wahrscheinlich zu verschiedenen Zeitpunkten zunehmen. In diesen Phasen werden wir versuchen, dies zu unserem Vorteile zu nutzen und das Portfolio zur Erzielung überdurchschnittlicher Gesamtrenditen proaktiv positionieren.

Uncorrelated Strategies – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -8,86 %. Der als Benchmark dienende Index, der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) (der Index), rentierte im selben Zeitraum 5,12 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- 2023 war ein starkes Jahr für Risikoanlagen, vor allem für US-amerikanische Large-Cap-Aktien, und das trotz der Zinsen (jetzt mehr als 5 % über den jüngsten Tiefständen), des Zusammenbruchs einer Reihe von Banken in den USA und Europa sowie der anhaltenden Konflikte in der Ukraine und im Nahen Osten. Im letzten Quartal des Jahres haben die Märkte eine nachlassenden Inflation, eine Senkung der Zinssätze und eine wohl weiche Landung in den USA, was durch die freundlichen Äußerungen der US-Notenbank im vierten Quartal unterstützt wurde, eingepreist.
- Der MSCI World Index (netto) erzielte im Berichtszeitraum eine Rendite von 23,8 %, und der Bloomberg Global Aggregate Index (USD) kam auf ein Plus von 7,15 %. Währungen bewegten sich im Jahresverlauf innerhalb einer größeren Bandbreite, wobei der US-Dollar (gemessen am US Dollar Index) mit -2,1 % abschloss.
- Wir sehen 2023 aus mehreren Gründen als ein anormales Jahr an. Erstens gab es einige Phasen, in denen die Volatilität von festverzinslichen Wertpapieren so hoch war wie seit über 20 Jahren nicht mehr, während bei Aktien die Lage ruhig blieb. Ein Beispiel wäre der März (mehr als die Hälfte des Jahresverlustes), als wir bei den extremen Kursbewegungen festverzinslicher Wertpapiere auf der falschen Seite standen (nachdem wir im Vorjahr auf der richtigen Seite waren) und für unsere volatilitätsfreundliche Positionierung nicht belohnt wurden, weil die Aktienmärkte ruhig blieben. So legte der S&P 500 vor dem Hintergrund von drei Bankenzusammenbrüchen und der Notrettung einer der ältesten Investmentbanken der Welt um 3,5 % zu.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Versicherungsgebundene Wertpapiere (1,17 %).
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Global Macro (-3,52 %), Trend Following (-1,94 %), Equity Market Neutral (-1,87 %), Short Term Trading (-1,64 %), Statistical Arbitrage (-0,70 %), Volatility Relative Value (-0,58 %)

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Risiko innerhalb der Allokation zu Statistical Arbitrage wurde im Dezember wieder hochgefahren.
- Darüber hinaus nahmen die Unterberater eine weitere Allokation in Statistical Arbitrage vor und begannen im Dezember, ihren Bestand aufzustocken.
- Bei einem anderen Unterberater haben wir die bestehende kurzfristige Gemini-Futures-Handelsstrategie zu dessen Advanced Trend Strategy hinzugefügt, um ein zweites hochwertiges Trendfolge-Standbein zu haben und von den zusätzlichen Vorteilen eines potenziellen Netting von Signalen und einer Reduzierung der Transaktionskosten zu profitieren.
- Schließlich kam es noch im November und Dezember zu einer Rücknahme im Rahmen der Allokation zu Equity Market Neutral.

Bei dieser Strategie beobachten wir historische Höchstrenditen in manchen der turbulentesten Phasen für risikoreichere Anlagen und 60/40-Portfolios. Das Engagement ist aktuell recht breit diversifiziert. Stresstests weisen allgemein auf positive Endergebnisse hin. In unseren Augen passt nicht, dass die Bewertungen von Aktien nach einer Erhöhung der Zinsen in der größten Volkswirtschaft der Welt um 500 Basispunkte nicht heftiger reagieren und das Volatilitätsniveau für gelassenes Vertrauen in die Fähigkeit der Zentralbanken spricht, uns durch einen „kurzfristigen" Inflationsschub zu einer sanften Landung mit minimalen wirtschaftlichen Problemen zu führen. Angesichts der Tatsache, dass Aktien das Jahr mit einem Plus von mehr als 20 % abschlossen und der Cboe Volatility Index (VIX) neue Tiefststände erreicht hatte, scheint es mehr denn je angemessen, sich nach Alternativen umzusehen, die eine echte Diversifizierung bieten. Letztlich sei erwähnt, dass wir von den neuen Ideen begeistert sind, die wir in der zweiten Jahreshälfte in das Portfolio aufgenommen haben. Wir hoffen, in den kommenden Monaten die Vorteile davon zu sehen.

Uncorrelated Trading* – Berichts des Investment-Managers

Für den Zeitraum vom 1. Januar 2023 bis zur Schließung des Portfolios am 24. Mai 2023 betrug die Gesamtrendite für die thesaurierende Klasse USD X -2,40 %. Der ICE BofA US Dollar 1-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 1,82 %. (Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen.)

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Die ersten vier Monate des Jahres waren fraglos eine schwierige Phase für das Portfolio. Daran schloss sich eine ruhigere Periode mit neutraler Ertragsentwicklung an, wobei angesichts einer kräftigen Risiko-Rally auf Schutz in Abwärtsrichtung geachtet wurde.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf seine Wertentwicklung auswirkten.

- Der Berichtszeitraum bot für unsere sechs Kernallokationen aus ganz verschiedenen Gründen ausnahmslos ein schwieriges Handelsumfeld. Das Jahr begann im Januar mit Verlusten, gefolgt von einem leichten Plus im Februar, bevor die Schaukelmärkte vom März dem Portfolio ein Abwärtsquartal bescherten. Das zweite Quartal verlief aus Wertentwicklungssicht verhaltener. Im April stand ein Minus zu Buche, bevor das Portfolio im Verlauf des Monats Mai einen vollständigen Risikoabbau durchführte.
- Für das erste Quartal wies das Portfolio ein Minus von 1,90 % aus. Für das negative Quartalsergebnis war dabei überwiegend die Wertentwicklung im Januar verantwortlich. Nach Strategien leistete unsere Allokation im Segment Equity Market Neutral einen positiven Beitrag, Short Term Trading, Volatility Relative Value und Statistical Arbitrage dagegen einen negativen. Im Quartal gaben alle Anlageklassen nach, angeführt von festverzinslichen Wertpapieren und gefolgt von Devisen- und Aktiengeschäften.
- Für das zweite Quartal wies das Portfolio ein Minus von 0,51 % aus, mit Verlusten im April und Mai. Nach Strategien leistete unsere Allokation im Segment Short Term Trading einen neutralen Wertbeitrag, Equity Market Neutral, Volatility Relative Value und Statistical Arbitrage dagegen einen negativen. Nach Anlageklassen wirkten sich Geschäfte mit Unternehmensanleihen und Zinssätzen positiv aus, solche mit Aktien und Devisen negativ.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Die Allokationen in Unterberater blieben im Berichtszeitraum unverändert.

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

US Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 36,82 %. Der als Benchmark dienende S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 25,67 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Wirtschaftsklima wurde im Verlauf des Jahres von einer Vielzahl von Faktoren geprägt, dabei u. a. Zinserhöhungen der Federal Reserve in der ersten Jahreshälfte gefolgt von einer Pause des Zinserhöhungszyklus in der zweiten Jahreshälfte.
- Trotz des verhaltenen Konjunkturausblicks legten die Märkte weiter kräftig zu, obwohl die Gewinne im S&P 500 insgesamt leicht nachgaben, was darauf zurückzuführen war, dass erhöhte Kosten auf die Margen drückten.
- Währenddessen sorgten durchwachsene Wirtschaftsdaten weiter für Volatilität auf dem Markt. Die stärksten Schwankungen betrafen die Renditekurven kurz laufender Staatsanleihen. Das rasante Zinserhöhungstempo löste auch Aktiv-Passiv-Inkongruenzen bei mehreren US-amerikanischen Regionalbanken aus, was die Sorgen um die gesamtwirtschaftliche Stabilität noch verstärkte.
- Trotz dieser Herausforderungen sorgten Zuversicht im Zusammenhang mit Fortschritten in der KI sowie ermutigende Gewinnmeldungen von Unternehmen, vor allem von Technologieriesen aus dem Mega-Cap-Segment, zumindest vorübergehend für eine gewisse Erleichterung.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
    - Die Einzeltitelauswahl war in den Sektoren Kommunikationsdienste und IT am positivsten.
    - Die Übergewichtung des Portfolios im IT-Sektor und seine Untergewichtung in Energiewerten steigerte den Ertrag aus Allokationsperspektive am meisten.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
    - Die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter und Versorger war nachteilig.
    - Aus Allokationssicht wirkte eine Übergewichtung der Barposition ertragsmindernd.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Am stärksten übergewichtet blieb das Portfolio in IT-Werten, am stärksten untergewichtet im Energiesektor. Das war auf unternehmensspezifische Faktoren zurückzuführen, wobei bei den Portfoliorisikofaktoren allgemein auf Ausgewogenheit geachtet wurde.
- Die Barposition des Portfolios verringerte sich im Berichtszeitraum infolge attraktiver Bewertungen und höherer Rentabilität in bestimmten Teilsegmenten des Marktes.

Gegen Ende des Jahres 2023 hat sich gezeigt, dass sich die Wirtschaft zwar verlangsamte, aber widerstandsfähiger war als von vielen erwartet. Anfang Januar lag die Konsensusprognose für eine Rezession bei einer Wahrscheinlichkeit von 2 zu 3, doch wird das BIP-Wachstum in den USA zum Jahresende auf sehr ansehnliche 2,5 % geschätzt. Des Weiteren haben sich die Gewinnschätzungen für den Index trotz der Forderungen nach einer stärkeren Senkung der Gewinne für das Gesamtjahr gehalten. Der Fokus liegt nun auf 2024. Zur selben Zeit hat die Fed Fortschritte im Kampf gegen die Inflation erzielt, und die Unternehmensgewinne liegen im Durchschnitt über den Erwartungen. Dessen ungeachtet sind die Kommentare zu den nachlassenden Konsumtrends, den anhaltenden Rückgängen bei den Verkäufen bestehender Häuser und den ersten Anzeichen eines nachgebenden Arbeitsmarktes ein deutlicher Hinweis darauf, dass der Straffungszyklus der Fed reale Auswirkungen auf die Gesamtwirtschaft hat. Trotzdem hat die Fed an ihrer Verpflichtung zur Bekämpfung der Inflation festgehalten. Diese hat sich zwar weiter verlangsamt, bleibt aber in bestimmten Kernbereichen wie Lebensmittel, Löhne und Wohnimmobilien hartnäckig, wobei die unerwartet guten Wirtschaftsdaten diese Idee unterstützen. Zwar haben Offizielle der Fed nun angedeutet, dass die Zinssätze wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, doch bleibt die Ungewissheit bestehen, wie lange die Zinsen auf diesem hohen Niveau bleiben werden, da die Anleger bereits schon im März mit Zinssenkungen rechnen. Bis wir mehr Klarheit über die Entwicklung der Wirtschaft und der Inflation haben und wie sich dies in tatsächlichen Zinssenkungen gegenüber den Erwartungen niederschlägt, rechnen wir mit einer anhaltenden Marktvolatilität. Im aktuellen Umfeld dürfte sich unseres Erachtens daher im weiteren Verlauf immer klarer abzeichnen, dass sich die operative Leistung der zugrunde liegenden Unternehmen auseinanderentwickelt. Wie immer setzen wir unsere Anstrengungen zum bestmöglichen Verständnis unternehmens- und portfoliospezifischer Faktoren fort, da dieses Umfeld unseres Erachtens vom Zusammenwirken einer Vielzahl von Faktoren wie fiskalpolitische Überlegungen, geldpolitische Anreize, Sorgen um die öffentliche Gesundheit, geopolitische Unsicherheit, Rohstoffpreisvolatilität und Inflationsdynamik geprägt ist. Bei Veränderungen der Marktdynamik kann dies zu einer Verzerrung des Marktwerts von Unternehmen gegenüber ihrem langfristigen potenziellen Wert führen, was für ein volatiles Umfeld sorgt, das potenzielle Gelegenheiten eröffnet.

US Equity Index PutWrite – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 15,39 %. In demselben Zeitraum verzeichnete die zu je 50 % aus dem Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index und dem Cboe S&P 500 PutWrite Index (zusammen der Index) zusammengesetzte Benchmark 11,69 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Trotz zahlreicher Konflikte, des Zusammenbruchs der Silicon Valley Bank, der rasanten Preisinflation, Einwanderung, politischer Kontroversen, Streiks der Gewerkschaften und haushaltspolitischer Unwägbarkeiten schloss der S&P 500 Index das Jahr 2023 mit einer jährlichen Gesamtrendite von 25,67 % ab.
- Angesichts der positiven Dynamik am Aktienmarkt und der Erwartung, dass die Federal Reserve im Jahr 2024 einen Zinssenkungszyklus beginnen wird, ging die implizite Volatilität zum Jahresende zurück. Der Cboe S&P 500 Volatilitätsindex (VIX) lag im Jahresdurchschnitt bei 16,9 und damit deutlich unter seinem Durchschnitt von 25,6 für das Jahr 2022, obgleich nur wenige Punkte von seinem langfristigen Durchschnitt entfernt. Der Optionsmarkt für den S&P 500 Index setzte seine positive Entwicklung bzgl. der impliziten Volatilitätsprämie mit einer durchschnittlichen Prämie von 4,3 im Jahr 2023 fort.
- Viele alternative Strategien schnitten im Vergleich zu ihrer jüngeren Vergangenheit – gekennzeichnet durch Nullzinsen und volatile Aktienmärkte, die das Renditepotenzial schmälerten – gut ab. Insgesamt legten Aktienindex-Putwriting-Strategien im Vergleich zu gängigen Anlagestrategien eine gute Performance vor, und unserer weniger direktionalen Indexoptionsstrategie gelang es, durch die Umkehr der Performance des S&P 500 von August bis Dezember zu navigieren. Wir denken, dass sich diese Trends fortsetzen könnten, wenn die wirtschaftliche und politische Unsicherheit in den USA die Renditen an den Aktien- und Kreditmärkten abkühlt und sich die Marktunsicherheit im neuen Jahr verflüchtigt und von den jüngsten Tiefständen erholt.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Auf Jahressicht erzielte das Optionssegment des S&P 500 eine beachtliche Rendite von 15,50 % und übertraf die Rendite des Cboe S&P 500 PutWrite Index von 14,32 %. Im selben Zeitraum blieb der Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index mit einer Rendite von 9,07 % deutlich zurück. Parallel dazu gewann das Sicherheitenportfolio im bisherigen Jahresverlauf 4,39 % dazu, während sich der Ertrag des ICE BofA 0-3 Month US T-Bill Index auf 5,01 % belief.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die relativen Renditen wurden während des Berichtszeitraums durch keinerlei Beteiligungen beeinträchtigt.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das durchschnittliche rechnerische Optionsengagement des Portfolios entsprach im Berichtszeitraum durchgehend dem strategischen Ziel von 100% S&P 500 Index.

Wir glauben nicht, dass die wirtschaftliche Rezession, die für 2023 „so sicher" war, in der ersten Hälfte von 2024 wahrscheinlicher wird. Unsere einfache Hypothese lautet: Die höheren Portfolioerträge, die den Anlegern in Form von Zinszahlungen zugute kommen, werden auch weiterhin eine kurzfristige Einkommensverbesserung für die große amerikanische obere Mittelschicht darstellen. Der direkte wirtschaftliche Stimulus, der den Verbrauchern und Vermögensbesitzern von der Federal Reserve gegeben wurde, hat sich nun auf die Vergabe von Zinszahlungen (Cashflows) durch das US-Finanzministerium an die Inhaber von Schuldtiteln verlagert. Bei Letzteren handelt es sich meist um wohlhabende Anleger und Institutionen. Der unmittelbare Einkommenszuwachs für Unternehmen, die Ausgaben tätigen, wird nicht sofort durch den Anstieg der längerfristigen Finanzierungskosten ausgeglichen, die auf Anleger und Unternehmen in den kommenden Jahren zukommen werden. Wir glauben daher nicht, dass die Fed die „Handbremse" für die Wirtschaft ziehen muss, denn die „weiche Landung" ist bereits im Gange. Wir sind allerdings mit Blick auf die ersten Quartale 2024 der Meinung, dass die Aussichten für Aktien sehr viel unklarer werden könnten. Hinzu kommt eine konfliktbehaftete Präsidentschaftswahl in den Vereinigten Staaten im November, wodurch 2024 ein Jahr mit einer relativ hohen Volatilität sein könnte.

US Large Cap Value – Bericht des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I -2,63 %. Der als Benchmark dienende Russell 1000 Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 10,68 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt setzte im Laufe des Jahres gegen mehrere Gegenwinde durch, darunter eine erhöhte Inflation, Zinserhöhungen der Federal Reserve, die Sorge, dass die Wirtschaft in eine Rezession abgleiten könnte, eine Mini-Krise im regionalen Bankensektor und zahlreiche geopolitische Ereignisse. Trotz alledem wuchs die Wirtschaft weiter und die Unternehmensergebnisse übertrafen oftmals die Erwartungen.
- Die Anlegerstimmung verbesserte sich gegen Ende des Jahres, als die Fed eine Kehrtwende vollzog, indem sie das wahrscheinliche Ende der Zinserhöhungen und das Potenzial für Zinssenkungen im Jahr 2023 andeute.
- Im Laufe des Jahres wurde der Markt von Mega-Caps im Technologiebereich und Unternehmen, die sich mit KI beschäftigen, angeführt.
- Alles in allem brachte der S&P 500 Index im Berichtszeitraum mit 25,67 % eine höhere Rendite als der Index, der 10,68 % verbuchte.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl im Basiskonsumgütersektor (angeführt von Nahrungsmitteln).
  - Was die Einzeltitel angeht, so war Oracle Corp. übergewichtet und Walt Disney Company sowie CVS Health Corp. waren untergewichtet.
  - Aus Sicht der Sektorpositionierung waren Energie unter- und Werkstoffe übergewichtet.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Für die meisten Wertabzüge verantwortlich zeichneten in puncto Sektorallokation eine Untergewichtung von Kommunikationsdiensten, eine Übergewichtung von Versorgern und eine Untergewichtung von IT.
  - Die Einzeltitelauswahl unter Industriewerten (vor allem Maschinen), im Gesundheitswesen (vor allem Geräte und Zubehör) und Werkstoffe (vor allem Metalle und Bergbau).
  - Zu nennenswerten Positionierungen bei Einzeltiteln gehörten eine Nullgewichtung von Meta Platforms, Inc. Klasse A, zusammen mit Übergewichtungen von Exelon Corp. und Pfizer, Inc.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios liegt die Bottom-up-Einzeltitelauswahl zugrunde, und am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größten Übergewichtungen gegenüber dem Index in den Sektoren Versorger und Basiskonsumgüter.
- Die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren waren Finanzen und IT.

Wir schätzen auch weiterhin die Auswirkungen einer Konjunkturabschwächung ab und bleiben bei unserem vorsichtigem Ausblick, insbesondere bezüglich der Entwicklungen, die eine nachlassende Nachfrage in Aussicht stellt. Daher bewerten wir, welche Risiken für unsere Portfoliopositionen angemessen sind und welche Aktien vor diesem Hintergrund am attraktivsten wirken. Wir sehen auf kurze Sicht eine schwierigere Zeit vor uns, während die Preise dies unserer Meinung nach nicht widerspiegeln. In den weniger konjunktursensiblen Bereichen des Marktes sind wir weiter übergewichtet, was sich auf individuelle Titel bezieht, die wir für attraktiv bewertet halten und die aus den Sektoren Basiskonsumgüter, Gesundheitswesen und Versorger stammen. Wir sind nach wie vor aktive wertorientierte Large-Cap-Manager, die an ihrer Disziplin festhalten und das Portfolio nach Möglichkeit so aufstellen, dass es die interessantesten Chancen nutzen kann, die wir im aktuellen Umfeld erkennen.

US Long Short Equity – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 13,34 %. Die als Benchmark dienenden zwei Indizes, der S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) und der HFRX Equity Hedge Index (Total Return, USD) verbuchten im selben Zeitraum ein Plus von 25,67 % bzw. 6,90 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Das Wirtschaftsklima wurde im Verlauf des Jahres von einer Vielzahl von Faktoren geprägt, dabei u. a. Zinserhöhungen der Federal Reserve in der ersten Jahreshälfte gefolgt von einer Pause des Zinserhöhungszyklus in der zweiten Jahreshälfte.
- Trotz des verhaltenen Konjunkturausblicks legten die Märkte weiter kräftig zu, obwohl die Gewinne im S&P 500 insgesamt leicht nachgaben, was darauf zurückzuführen war, dass erhöhte Kosten auf die Margen drückten.
- Währenddessen sorgten durchwachsene Wirtschaftsdaten weiter für Volatilität auf dem Markt. Die stärksten Schwankungen betrafen die Renditekurven kurz laufender Staatsanleihen. Das rasante Zinserhöhungstempo löste auch Aktiv-Passiv-Inkongruenzen bei mehreren US-amerikanischen Regionalbanken aus, was die Sorgen um die gesamtwirtschaftliche Stabilität noch verstärkte.
- Trotz dieser Herausforderungen sorgten Zuversicht im Zusammenhang mit Fortschritten in der KI sowie ermutigende Gewinnmeldungen von Unternehmen, vor allem von Technologieriesen aus dem Mega-Cap-Segment, zumindest vorübergehend für eine gewisse Erleichterung.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Beim Gesamtertrag schnitten Long-Positionen in Aktien besser ab als der breite Markt.
  - Am vorteilhaftesten fiel die Einzeltitelauswahl unter Long-Positionen in Aktien aus den Sektoren Finanzen, Kommunikationsdienste und Industrie aus.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Das Short-Engagement auf dem Markt – darunter breite marktkapitalisierungs-, sektor- und anlagestilspezifische Absicherungen.
  - Am nachteiligsten fiel die Einzeltitelauswahl unter Long-Positionen in Aktien aus den Sektoren Nicht-Basiskonsumgüter und Werkstoffe aus.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Nettoengagement des Portfolios erhöhte sich schrittweise auf eine Netto-Long-Position von ca. 40 % bis 45 %, während sich das rechnerische Bruttoengagement in den Bereich von rund 125 % bis 130 % steigerte.
- Das fundamentale Short-Engagement verringerte sich insgesamt, allen voran durch einen Rückgang von Short-Positionen in den Sektoren Industrie, Werkstoffe und Kommunikationsdienste.
- Das Short-Engagement auf dem Markt im Zusammenhang mit Absicherungen stieg an.

Gegen Ende des Jahres 2023 hat sich gezeigt, dass sich die Wirtschaft zwar verlangsamte, aber widerstandsfähiger war als von vielen erwartet. Anfang Januar lag die Konsensusprognose für eine Rezession bei einer Wahrscheinlichkeit von 2 zu 3, doch wird das BIP-Wachstum in den USA zum Jahresende auf sehr ansehnliche 2,5 % geschätzt. Des Weiteren haben sich die Gewinnschätzungen für den S&P 500 Index trotz der Forderungen nach einer stärkeren Senkung der Gewinne für das Gesamtjahr gehalten. Der Fokus liegt nun auf 2024. Zur selben Zeit hat die Fed Fortschritte im Kampf gegen die Inflation erzielt, und die Unternehmensgewinne liegen im Durchschnitt über den Erwartungen. Dessen ungeachtet sind die Kommentare zu den nachlassenden Konsumtrends, den anhaltenden Rückgängen bei den Verkäufen bestehender Häuser und den ersten Anzeichen eines nachgebenden Arbeitsmarktes ein deutlicher Hinweis darauf, dass der Straffungszyklus der Fed reale Auswirkungen auf die Gesamtwirtschaft hat. Trotzdem hat die Fed an ihrer Verpflichtung zur Bekämpfung der Inflation festgehalten. Diese hat sich zwar weiter verlangsamt, bleibt aber in bestimmten Kernbereichen wie Lebensmittel, Löhne und Wohnimmobilien hartnäckig, wobei die unerwartet guten Wirtschaftsdaten dieses Idealszenario unterstützen. Zwar haben Offizielle der Fed nun angedeutet, dass die Zinssätze wahrscheinlich ihren Höchststand erreicht haben, doch bleibt die Ungewissheit bestehen, wie lange die Zinsen auf diesem hohen Niveau bleiben werden, da die Anleger bereits schon im März mit Zinssenkungen rechnen. Bis wir mehr Klarheit über die Entwicklung der Wirtschaft und der Inflation haben und wie sich dies in tatsächlichen Zinssenkungen gegenüber den Erwartungen niederschlägt, rechnen wir mit einer anhaltenden Marktvolatilität. Im aktuellen Umfeld dürfte sich unseres Erachtens daher im weiteren Verlauf immer klarer abzeichnen, dass sich die operative Leistung der zugrunde liegenden Unternehmen auseinanderentwickelt. Wie immer setzen wir unsere Anstrengungen zum bestmöglichen Verständnis unternehmens- und portfoliospezifischer Faktoren fort, da dieses Umfeld unseres Erachtens vom Zusammenwirken einer Vielzahl von Faktoren wie fiskalpolitische Überlegungen, geldpolitische Anreize, Sorgen um die öffentliche Gesundheit, geopolitische Unsicherheit, Rohstoffpreisvolatilität und Inflationsdynamik geprägt ist. Bei Veränderungen der Marktdynamik kann dies zu einer Verzerrung des Marktwerts von Unternehmen gegenüber ihrem langfristigen potenziellen Wert führen, was für ein volatiles Umfeld sorgt, das potenzielle Gelegenheiten eröffnet.

US Multi Cap Opportunities – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD1 I 18,10 %. Der S&P 500 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) rentierte im selben Zeitraum 25,67 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Im Jahr 2023 zeigte sich die US-Wirtschaft in einem Umfeld mit steigenden Zinssätze widerstandsfähig, was sich in einem positiven BIP-Wachstum, einem robusten Arbeitsmarkt und einer starken Verbrauchernachfrage ausdrückte. Die Anlegerstimmung in Bezug auf US-Aktien fand Unterstützung durch eine mäßige Inflation und eine Verbesserung der Aussichten für das globale Wachstum.
- Die Aktienmarktrenditen für den Index wurden vor allem von der Outperformance ausgewählter Large-Caps aus dem Growth-Segment und technologieorientierter Unternehmen getragen.
- Bei den Renditen am US-Aktienmarkt war die Outperformance ausgewählter Large-Caps aus dem Growth-Segment und technologieorientierter Aktien führend. Dies resultierte in einer beträchtlichen Konzentration der Marktrenditen, wie der Performanceunterschied zwischen dem Index und dem S&P 500 Equal Weight Index von 1.242 Basispunkten veranschaulicht. Dies war die seit 1998 größte Outperformance des Index gegenüber dem Equal Weight Index in einem Kalenderjahr und eröffnet Chancen für das Jahr 2024, da sich die Anlagestile in der Regel in ihrer Beliebtheit abwechseln.
- Die „Glorreichen Sieben"[1] waren in 2023 für über 60 % der Rendite des Index verantwortlich.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Eine starke Einzeltitelauswahl unter Basiskonsumgütern, in Energie, bei Finanzwerten, Werkstoffen und Versorgern
  - Eine Übergewichtung der Sektoren Kommunikationsdienste und Nicht-Bonsumgüter
  - Untergewichtete Positionen in den Sektoren Energie, Gesundheitswesen und Versorger und kein Engagement im Immobilienbereich
  - Unser uneingeschränkter Multi-Cap-Ansatz hat zur Identifizierung einer Reihe von Investitionen geführt, die nicht im Index enthalten sind und die sich positiv auf die relative Performance ausgewirkt haben. Im Jahr 2023 waren sechs der acht Einzelwerte mit der besten Performance Unternehmen, die nicht im Index vertreten sind.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Untergewichtung des IT-Sektors und die Einzeltitelauswahl in den Sektoren Kommunikationsdienste und Nicht-Basiskonsumgüter. Der Gegenwind für die relative Performance war im Wesentlichen darauf zurückzuführen, dass das Portfolio bei den „Glorreichen Sieben" unterdurchschnittlich engagiert war.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Das Portfolio beendete den Berichtszeitraum mit einer Übergewichtung in den Sektoren Finanzen, Industrie und Werkstoffe sowie einer Untergewichtung im Gesundheitswesen und in der IT sowie ohne ein Engagement in Immobilien.

Wir sind der Ansicht, dass die Normalisierung der Inflation in Kombination mit einem anhaltenden Wirtschaftswachstum und einer angemessenen Verbrauchernachfrage ein attraktives Umfeld für US-Aktien im Jahr 2024 schafft. Während sich die Managementteams an das Zinsumfeld anpassen, sind wir der Auffassung, dass unser auf den freien Cashflow konzentrierter Ansatz, unser Verständnis der Kapitalstrukturen und unsere Bewertungsdisziplin von Vorteil sind. Ausgewählte Unternehmen sind im Stande, sich mit unternehmensspezifischen Lösungen von ihren Mitbewerbern abzusetzen, um auf den Inflationsdruck, die sich entwickelnden Zinssätze und die anhaltenden Veränderungen bei Nachfragetrends und Verbraucherverhalten zu reagieren. Die Tiefe unseres Wissensarchivs und Erfahrungsschatzes bleibt robust. Wir identifizieren auch weiterhin Unternehmen mit qualitativ hochwertigen Geschäftsmodellen und attraktiven freien Cashflow-Merkmalen, die zu überzeugenden Bewertungen gehandelt werden. Wir sind überzeugt, dass das Portfolio gut positioniert ist, da sich die Anleger zunehmend auf die unternehmerischen Fundamentaldaten konzentrieren.

[1] Die „Glorreichen Sieben" ist ein Spitzname für sieben technologiebezogene Mega-Caps aus dem Wachstumssegment, die deutlich besser abgeschnitten haben als der Rest der Aktien im S&P 500© Index, und setzen sich aus Alphabet (Klasse A & C), Amazon.com, Apple, Meta Platforms, Microsoft, NVIDIA und Tesla zusammen.

US Real Estate Securities – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 10,55 %. Der als Benchmark dienende FTSE Nareit All Equity REITs Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verbuchte im selben Zeitraum 9,95 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der US-Aktienmarkt zog im November und Dezember kräftig an, da das Zinsumfeld für 2024 vielversprechend aussah. Die US-Notenbank sollte die Zinsen in der ersten Jahreshälfte 2024 weitgehend in der Schwebe halten und die Anleger rechnen mit Zinssenkungen in der zweiten Jahreshälfte.
- Die Inflation kühlte sich ab, und die Verbraucherausgaben blieben solide, auch wenn sie sich abschwächten. Obwohl sich das Tempo der Neueinstellungen verlangsamt hat und die Zahl der offenen Stellen zurückgegangen ist, sind die Arbeitsmärkte weiterhin stark.
- Insgesamt rentierte der S&P 500 Index im Berichtszeitraum 25,67 %. Immobilienaktiengesellschaften (REITs) rentierten im Berichtszeitraum wie vom Index gemessen mit 9,95 % und schnitten schlechter ab als der breite US-Aktienmarkt.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtungen in den Sektoren Büroraum und diversifizierte Immobilien.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Büroraum.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Speciality REITs.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Untergewichtung in den Sektoren Rechenzentren und Beherbergung.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Rechenzentren.
  - Die Einzeltitelauswahl im Sektor Einkaufszentren-REITs.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios liegt überwiegend die Bottom-up-Einzeltitel zugrunde. Am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größte Übergewichtungen im Verhältnis zur Benchmark in den Sektoren Selbsteinlagerung und Infrastruktur-REITs. Im Gegensatz dazu waren die im Portfolio gegenüber dem Index am stärksten untergewichteten Sektoren Rechenzentren und Büroraum.

Nach einem schwierigen Jahr 2023, das weitgehend von der geldpolitischen Straffungskampagne der Fed diktiert wurde, erscheint uns das Zinsumfeld für 2024 vielversprechend. Die US-Notenbank legt in der ersten Jahreshälfte 2024 weitgehend eine Pause ein und die Anleger rechnen mit Zinssenkungen in der zweiten Jahreshälfte. Dieses Szenario spielt sich allerdings vor dem Hintergrund einer größeren wirtschaftlichen Unsicherheit ab, die sich durch einen schwächelnden Verbraucher, der weniger spart und ein langsameres Beschäftigungswachstum hinnehmen muss, das geringe Vertrauen der Unternehmen, das erhöhte Angebot in bestimmten Sektoren und die gestiegenen Kapitalkosten und Ausgaben, die die Gewinnspannen belasten, auszeichnet. Der allgemeine Druck auf das Wachstum wird dazu führen, dass den Bewertungen, der Ertragsqualität und der Stärke der unternehmerischen Fundamentaldaten mehr Aufmerksamkeit geschenkt wird, und unserer Meinung nach wird dies gut kapitalisierten REITs in ausgewählten Sektoren zugute kommen, deren Nachfrage weniger zyklisch oder nicht übermäßig verbraucherabhängig ist. Angesichts der zweijährigen relativen Underperformance von REITs gegenüber dem breiteren Markt (~20 %), des relativ niedrigen Verschuldungsprofils (~33 % Gesamtverschuldung/Bruttovermögenswert) und des stärkeren Dividendenprofils (~4 % REIT-Dividendenrendite gegenüber 1,5 % Rendite des S&P 500) bieten REITs bessere relative Werte, falls das Wachstum auf breiter Front enttäuscht oder die Kapitalkosten weiter steigen. Wir denken, dass viele REITs mit einem Abschlag auf den NIW und zu ihren privaten Pendants gehandelt werden (~200 Bp beim Cap-Rate-Differenzial). In einem „normalen" Inflationsumfeld und einem sich verlangsamenden Wachstum bieten REITs ein langsames, aber verlässliches Wachstum und gleichzeitig einen Inflationsschutz.

US Small Cap – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 15,36 %. Der als Benchmark dienende Russell 2000 Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 16,41 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Der Markt setzte im Laufe des Jahres gegen mehrere Gegenwinde durch, darunter eine erhöhte Inflation, Zinserhöhungen der Federal Reserve und die Sorge, dass die Wirtschaft in eine Rezession abgleiten könnte. Die Anlegerstimmung war gegen Ende des Jahres positiv, was vor allem auf das „Umschwenken" der Fed zurückzuführen war: Sie deutete das wahrscheinliche Ende der Zinserhöhungen und das Potenzial für Zinssenkungen im Jahr 2024 an.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Einzeltitelauswahl war positiv in den Sektoren Gesundheitswesen, Werkstoffe und Technologie.
  - Eine Übergewichtung der Softwarebranche innerhalb des IT-Sektors verbuchte den größten Mehrwert. Unsere Übergewichtung im Industriesektor und das Fehlen von Versorgern trugen ebenfalls erheblich zur Wertsteigerung bei.
  - Zu den individuellen Namen, die am meisten zur absoluten Performance beitrugen, gehörten Fair Isaac Corp., Manhattan Associates, Inc. und Qualys, Inc.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Bestände in den Sektoren Industrie und Finanzen belasteten die Ergebnisse.
  - Die Untergewichtung des Portfolios von Regionalbanken innerhalb des Finanzsektors und das Fehlen von Titeln aus dem Bereich Gebrauchsgüter beeinträchtigten die relative Wertentwicklung am stärksten.
  - Unter den Einzeltiteln, die die absolute Wertentwicklung am stärksten beeinträchtigten, waren Valmont Industries, Inc., Driven Brands Holdings, Inc. und CVB Financial Corp.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Der Sektorpositionierung des Portfolios liegt die Bottom-up-Einzeltitelauswahl zugrunde, und am Ende des Berichtszeitraums bestanden die größte Übergewichtungen gegenüber dem Index in den Sektoren IT und Industrie. Demgegenüber waren Finanzwerte und Immobilien am stärksten untergewichtet.

In den vergangenen zwei Jahren war die Fed voll und ganz auf die Wiederherstellung der Preisstabilität fokussiert. Dabei hatte sie das Ziel, die Nachfrage zu drosseln, um die Inflation unter Kontrolle zu bringen. Jüngste Kommentare der Fed deuten an, dass der Straffungszyklus seinen Höhepunkt erreicht hat, doch wird gleichzeitig darauf hingewiesen, dass die Zinssätze auf einem hohen Niveau bleiben werden. Die Wirtschaftstätigkeit bleibt insgesamt relativ stabil, wobei einige Indikatoren eine wirtschaftliche Abkühlung andeuten. Mit Blick auf diesen Hintergrund reagieren die Aktienmärkte weiterhin höchst empfindlich auf die Stellungnahmen der Fed, die eingehenden Daten zur Inflation und die ökonomischen Indikatoren. Wenn wir etwas Abstand nehmen, so zeigt sich, dass die Märkte möglicherweise in eine neue Phase eingetreten sind. Insbesondere sind die Kapitalkosten erheblich gestiegen, Finanzierungen sind schwieriger geworden und die Risikoaversion ist zurückgekehrt. Allerdings hat der jüngste Optimismus hinsichtlich möglicher Zinssenkungen zu einer Lockerung der finanziellen Bedingungen und zu einer erhöhten Risikobereitschaft geführt. Die Gefahr einer Rezession liegt weiter in den USA und weltweit im Bereich des Möglichen, doch dass sie eintritt, steht keinesfalls fest. Da die makroökonomische Entwicklung unsicher ist, versuchen wir, das Portfolio weiterhin ausgewogen aufzustellen. Wir sind nach wie vor zuversichtlich, dass unser qualitativ hochwertiges Portfolio aus Unternehmen mit attraktiven Finanzmerkmalen, differenzierten und beständigen Geschäftsmodellen und nachhaltigen Ertragssteigerungen gut aufgestellt ist, um diese unsicheren Zeiten zu überstehen und überdurchschnittliche risikobereinigte Ergebnisse zu liefern.

US Small Cap Intrinsic Value – Berichts des Investment-Managers

Für den zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023 betrug die Gesamtrendite für Anteile der Thesaurierenden Klasse USD I 14,17 %. Der als Benchmark dienende Russell 2000 Value Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD) (der Index) verzeichnete im selben Zeitraum ein Plus von 13,87 %. (Die Performance für alle Anteilklassen ist im Anhang II aufgeführt. Die zur Wertentwicklung gemachten Angaben beziehen sich auf die Wertentwicklung in der Vergangenheit und sind kein Hinweis auf künftige Ergebnisse. Die Angaben zur Gesamtrendite erfolgen nach Abzug aller Gebühren und Kosten und berücksichtigen eine Wiederanlage von etwaigen Dividendenerträgen und sonstigen Ausschüttungen).

Im Berichtszeitraum vorliegende Bedingungen für Gesamtwirtschaft, Markt und Anlageklasse

- Wer hätte gedacht, dass sich die Stimmung so schnell ändern könnte? Innerhalb von nur zwei Wochen verflüchtigte sich das Mantra „höhere Zinsen für länger" schlagartig, nachdem es vormals den Enthusiasmus der Anleger für die meisten Aktien – wovon die „glorreichen Sieben" – ausgenommen waren – erstickt hatte. Gerade als die höheren Zinssätze verschuldete Unternehmen und die Unternehmensgewinne erneut in Mitleidenschaft zu ziehen drohten, erinnerte sich die Federal Reserve angemessenerweise an die andere Hälfte ihres Doppeltmandats, namentlich die maximale Beschäftigung.
- Unsere Einschätzung der Wirtschaft und der Inflation war konsistent. Die Inflation würde zurückgehen, wenn auch nicht auf 2 %, aber niedriger als die Niveaus, die wir 2022 und Anfang 2023 gesehen haben, und ein weitreichender Abbau von Arbeitsplätzen war unwahrscheinlich. Die Wildcard war das Bekenntnis der Fed zum 2 %-Ziel. Eine zu harte Haltung hätte unter Umständen eine Rezession zur Folge, und eine zu weiche Haltung würde die Märkte für langfristige Staatsanleihen untergraben. Ob sie das richtige Gleichgewicht gefunden hat, wird sich erst noch zeigen, aber die „große Enthüllung", dass die Fed sich mit den Inflationsaussichten wohlzufühlen beginnt, wurde äußerst positiv aufgenommen.
- Zwei beachtenswerte Ideen sind zum einen, dass die Inflation im kommenden Jahrzehnt strukturell höher sein wird als im vergangenen, und zum anderen, dass die demografischen Trends – außer es kommt zu einem großen Schock – das Risiko eines erheblichen Anstiegs der Arbeitslosigkeit verringern. Insbesondere in der verarbeitenden Industrie altern die Fachkräfte viel schneller, als dass neue Arbeitskräfte hinzukommen. Die Unternehmen berichten uns, dass der Fachkräftemangel real ist und es viel Zeit in Anspruch nimmt und teuer ist, neue Mitarbeiter auf den aktuellen der technologischen Entwicklungen zu bringen. Diese Trends stehen im Zusammenhang mit einer wichtigen Säule unserer Strategie, d. h. die Notwendigkeit von Technologien zur Bewältigung der vor uns liegenden Herausforderungen in puncto Produktivität und Arbeit. Wir sehen weiterhin säkularen Rückenwind für Unternehmen, die Produktivität verkaufen.

Faktoren, die sich im Berichtszeitraum auf die Wertentwicklung des Portfolios auswirkten

- Positivbeiträge zur relativen Rendite:
  - Die Übergewichtung von Technologiewerten und die Performance einzelner Titel übertrafen im Allgemeinen unsere Erwartungen und waren sowohl den absoluten als auch den relativen Renditen förderlich. Vier der fünf Unternehmen mit der besten Wertentwicklung waren IT-Unternehmen.
- Negativbeiträge zur relativen Rendite:
  - Wir haben die regionale Bankenkrise nicht gut navigiert, da wir unsere Positionen in Banktiteln während der Talsohle nicht aufgestockt und sie dann vor der Rally im vierten Quartal reduziert haben. Das Ergebnis war sowohl absolut als auch relativ negativ.
  - Die Umschichtung der Erlöse aus dem Verkauf regionaler Banktitel in Versorger milderte die negativen Auswirkungen zwar etwas ab, aber nicht genug.
  - Unsere jüngsten aktiven Engagements und Kapitalzuführungsstrategien müssen sich erst noch auszahlen, aber wir arbeiten weiter an ihnen. Jedes Unternehmen hat andere Punkte auf der Tagesordnung, doch zielen alle darauf ab, die Bedenken der Anleger zu berücksichtigen und Lösungen vorzuschlagen, die Shareholder Value schaffen.

Überblick über die Anlagetätigkeit im Berichtszeitraum

- Wir haben die Einführung neuer Ideen in das Portfolio forciert und bestehende Beteiligungen aktiv neu gewichtet. Insgesamt haben wir zwölf neue Ideen aufgenommen und sieben eliminiert. Wir haben weitere 13 % des Portfolios umgeschichtet (8 % Prozent wurden zu bestehenden Titeln hinzugefügt und 5 % wurden gekürzt).
- Insgesamt war 2023 ein Jahr mit einer begrenzten Zahl an Fusionen und Übernahmen, doch wurden dennoch drei Unternehmen erworben und ein viertes ist Gegenstand eines Angebots. Zum Jahresende lag der Abschlag des Portfolios zum intrinsischen Wert bei 29,3 % und entsprach damit mehr oder weniger dem 26-jährigen Durchschnitt.

Was erwartet uns im Jahr 2024? Es ist schwer, das mit Überzeugung zu sagen, und ehrlich gesagt hat sich im letzten Jahr fast jeder geirrt. Die Anleger und Kunden sollten aber eine Lehre aus dem Jahr 2023 ziehen, nämlich dass nur sehr wenige Menschen oder Firmen in der Lage sind, beim Markt-Timing richtig zu liegen. Unsere Empfehlung lautet: Investieren Sie entsprechend Ihrer Risikotoleranz, legen Sie Ihre Allokation fest und bleiben Sie auf Kurs. Unserer Meinung nach sind die Risiken im Jahr 2024 offenkundig: eine dysfunktionale Innenpolitik, föderale Haushaltsungleichgewichte, Kriege in Osteuropa und im Nahen Osten mit nur minimalen Lösungsansätzen und zu allem Überfluss noch eine Präsidentschaftswahl, bei der beide Spitzenkandidaten Mängel aufweisen. Doch wenn die vor uns liegenden Herausforderungen beängstigend erscheinen, so halten wir inne und blicken zurück in die Vergangenheit. Wir begannen die Strategie vor über 25 Jahren mit 7 Mio. USD an Kundengeldern und einer persönlichen Investition von 50.000 USD. Ende 2023 belief sich das verwaltete Kundenvermögen auf 4,1 Milliarden USD, und die persönliche Investition von 50.000 USD hat nun eine Wert von in etwa 750.000 USD.

[1] Die „Glorreichen Sieben" ist ein Spitzname für sieben technologiebezogene Mega-Caps aus dem Wachstumssegment, die deutlich besser abgeschnitten haben als der Rest der Aktien im S&P 500©Index, darunter Alphabet (Klasse A & C), Amazon.com, Apple, Meta Platforms, Microsoft, NVIDIA und Tesla.

5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 94,92 % (31. Dezember 2022: 95,96 %)		
	Chinesischer Yuan Renminbi		
1.111.700	Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A	2.360.602	0,23
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt	**2.360.602**	**0,23**
	Euro		
38.930	ASM International NV	20.209.741	1,94
20.169	ASML Holding NV	15.188.061	1,45
96.726	BE Semiconductor Industries NV	14.579.461	1,40
541.903	Deutsche Telekom AG	13.019.836	1,25
441.142	Infineon Technologies AG	18.420.223	1,76
	Euro insgesamt	**81.417.322**	**7,80**
	Japanischer Yen		
80.500	Advantest Corp	2.739.101	0,26
71.800	Disco Corp	17.815.037	1,71
46.700	Keyence Corp	20.577.415	1,97
1.409.100	Renesas Electronics Corp	25.477.344	2,44
159.500	Sony Group Corp	15.171.620	1,45
441.600	TDK Corp	21.040.057	2,02
	Japanischer Yen insgesamt	**102.820.574**	**9,85**
	Neuer taiwanesischer Dollar		
399.000	Alchip Technologies Ltd	42.577.508	4,08
960.000	Novatek Microelectronics Corp	16.171.780	1,55
1.642.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	31.726.625	3,04
	Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt	**90.475.913**	**8,67**
	Südkoreanischer Won		
245.713	SK Hynix Inc	26.816.617	2,57
	Südkoreanischer Won insgesamt	**26.816.617**	**2,57**
	US-Dollar		
262.468	Advanced Micro Devices Inc	38.690.408	3,71
297.712	Amazon.com Inc	45.234.361	4,33
66.028	Analog Devices Inc	13.110.520	1,26
50.840	Apple Inc	9.788.225	0,94
50.257	Applied Materials Inc	8.145.152	0,78
90.522	Arista Networks Inc	21.318.836	2,04
93.888	ARM Holdings Plc ADR	7.055.214	0,68
94.554	Atlassian Corp Class A	22.490.614	2,16

5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 94,92 % (31. Dezember 2022: 95,96 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
751	Booking Holdings Inc	2.663.962	0,26
27.828	Broadcom Inc	31.063.005	2,98
63.142	Cadence Design Systems Inc	17.197.987	1,65
36.538	Crowdstrike Holdings Inc Class A	9.328.882	0,89
208.542	Dexcom Inc	25.877.977	2,48
21.689	Eaton Corp Plc	5.223.145	0,50
40.394	HubSpot Inc	23.450.333	2,25
16.968	Intuitive Surgical Inc	5.724.324	0,55
528.712	Juniper Networks Inc	15.586.430	1,49
46.232	Keysight Technologies Inc	7.355.049	0,70
30.094	Lam Research Corp	23.571.426	2,26
110.353	Meta Platforms Inc Class A	39.060.548	3,74
104.445	Microsoft Corp	39.275.498	3,76
96.185	NVIDIA Corp	47.632.736	4,56
153.535	ON Semiconductor Corp	12.824.779	1,23
270.185	Oracle Corp	28.485.605	2,73
89.541	Palo Alto Networks Inc	26.403.850	2,53
387.433	Pure Storage Inc Class A	13.815.861	1,32
82.442	QUALCOMM Inc	11.923.586	1,14
70.500	Salesforce Inc	18.551.370	1,78
46.461	ServiceNow Inc	32.824.232	3,15
70.675	Shopify Inc Class A	5.505.582	0,53
99.153	Super Micro Computer Inc	28.185.232	2,70
32.369	Take-Two Interactive Software Inc	5.209.791	0,50
211.655	T-Mobile US Inc	33.934.646	3,25
36.641	Workday Inc Class A	10.115.114	0,97
	US-Dollar insgesamt	**686.624.280**	**65,80**
	Aktien insgesamt *	**990.515.308**	**94,92**
	Anlagen insgesamt	**990.515.308**	**94,92**

Devisenterminkontrakte 0,61 % (31. Dezember 2022: 1,22 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
Abgesicherte Klassen AUD						
3.948.394 AUD	2.579.979 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	13	115.612	0,01
696.985 AUD	456.183 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	19.652	0,00
573.103 AUD	370.991 US$	18.01.2024	UBS AG	2	20.269	0,00
21.900.510 AUD	14.130.556 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	35	821.036	0,08
Abgesicherte Klassen CHF						
76.928 CHF	85.632 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	4	5.919	0,00

5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,61 % (31. Dezember 2022: 1,22 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen CHF (Fortsetzung)						
13.950 CHF	15.761 US$	18.01.2024	UBS AG	12	840	0,00
6.770 CHF	7.724 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	333	0,00
Abgesicherte Klassen CNY						
291.481 CNY	40.233 US$	18.01.2024	UBS AG	5	746	0,00
3.472.387 CNY	478.736 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	18	9.446	0,00
Abgesicherte Klassen EUR						
9.456.865 €	10.275.297 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	9	177.730	0,02
88.894.777 €	94.834.454 US$	18.01.2024	UBS AG	12	3.424.281	0,33
5.721.251 €	6.153.273 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	37	170.643	0,02
6.241 US$	5.616 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	33	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
694.483 £	857.131 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	28.274	0,00
87.018 £	109.007 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	1.933	0,00
311.667 £	388.722 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	8.627	0,00
9.362.705 £	11.500.516 US$	18.01.2024	UBS AG	5	436.106	0,04
1.531.567 £	1.896.544 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	15	56.069	0,01
47.111 US$	36.889 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	81	0,00
Abgesicherte Klassen HKD						
5.654.265 HKD	723.620 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	741	0,00
1.472.853 HKD	188.630 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	56	0,00
62.389.405 HKD	7.989.483 US$	18.01.2024	UBS AG	8	3.156	0,00
2.383.665 HKD	305.191 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	17	178	0,00
54.343 US$	423.661 HKD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	68	0,00
1.933.508 US$	15.070.344 HKD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	15	2.862	0,00
Abgesicherte Klassen SGD						
2.336.338 SGD	1.724.430 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	48.027	0,01
508.702 SGD	379.575 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	6.351	0,00
1.418.044 SGD	1.064.895 US$	18.01.2024	UBS AG	3	10.900	0,00
44.816.988 SGD	33.045.101 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	55	955.178	0,09
28 US$	37 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
Abgesicherte Klassen ZAR						
114 US$	2.094 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	0	0,00
690.828 ZAR	37.274 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	10	451	0,00
5.045.789 ZAR	260.909 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	3	14.638	0,00
3.318.193 ZAR	179.218 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	18	1.986	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**6.342.222**	**0,61**

5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**996.857.530**	**95,53**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,10 %) (31. Dezember 2022: (0,33 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
Abgesicherte Klassen AUD						
147.263 AUD	100.812 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(274)	(0,00)
992.393 US$	1.546.473 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(63.392)	(0,01)
361.008 US$	563.241 AUD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(23.520)	(0,00)
67.197 US$	106.027 AUD	18.01.2024	UBS AG	1	(5.188)	(0,00)
2.671.718 US$	4.084.378 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	26	(116.707)	(0,01)
Abgesicherte Klassen CHF						
597 CHF	711 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(1)	(0,00)
3.196 US$	2.824 CHF	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(165)	(0,00)
8.541 US$	7.512 CHF	18.01.2024	UBS AG	6	(399)	(0,00)
1.321 US$	1.182 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(86)	(0,00)
Abgesicherte Klassen CNY						
94.683 CNY	13.324 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(12)	(0,00)
17.038 US$	122.883 CNY	18.01.2024	UBS AG	3	(239)	(0,00)
167.973 US$	1.209.849 CNY	18.01.2024	Westpac Banking Corp	9	(2.119)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
588.981 €	652.583 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(1.560)	(0,00)
47.149 €	52.403 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(288)	(0,00)
3.694.028 US$	3.442.660 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(111.274)	(0,01)
2.407.467 US$	2.255.602 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(85.735)	(0,01)
15.204.155 US$	14.078.907 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	86	(357.788)	(0,03)
Abgesicherte Klassen GBP						
139.155 £	177.995 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(585)	(0,00)
221.950 US$	182.697 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(10.972)	(0,00)
407.734 US$	330.105 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(13.121)	(0,00)
439.114 US$	355.200 £	18.01.2024	UBS AG	2	(13.734)	(0,00)
2.409.476 US$	1.941.754 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	21	(66.091)	(0,01)
Abgesicherte Klassen HKD						
1.377.027 HKD	176.649 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(239)	(0,00)
1.881.137 HKD	241.157 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(166)	(0,00)
1.815.417 HKD	232.671 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(100)	(0,00)
123.038 HKD	15.782 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	(18)	(0,00)
161.705 US$	1.262.698 HKD	18.01.2024	BNP Paribas	1	(58)	(0,00)
208.371 US$	1.627.981 HKD	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(187)	(0,00)

5G Connectivity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,10 %) (31. Dezember 2022: (0,33 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen HKD (Fortsetzung)						
51.443 US$	401.730 HKD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(22)	(0,00)
295.731 US$	2.310.628 HKD	18.01.2024	UBS AG	3	(281)	(0,00)
819.287 US$	6.401.992 HKD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	19	(867)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SGD						
306.133 SGD	232.263 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(16)	(0,00)
771.793 US$	1.054.366 SGD	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(28.098)	(0,00)
1.038.734 US$	1.403.661 SGD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(26.149)	(0,00)
1.900.650 US$	2.567.998 SGD	18.01.2024	UBS AG	4	(47.554)	(0,01)
1.783.972 US$	2.418.897 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	48	(51.116)	(0,01)
Abgesicherte Klassen ZAR						
16.471 US$	309.152 ZAR	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(412)	(0,00)
165.051 US$	3.109.718 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	17	(4.769)	(0,00)
974 US$	17.977 ZAR	02.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(9)	(0,00)
160.888 ZAR	8.795 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(10)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(1.033.321)**	**(0,10)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(1.033.321)**	**(0,10)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**995.824.209**	**95,43**
Sonstiges Nettovermögen	**47.702.734**	**4,57**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**1.043.526.943**	**100,00**

Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtver-mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	990.515.308	94,01
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	5.308.901	0,50
Anlagen insgesamt	**995.824.209**	**94,51**

Absolute Return Multi Strategy - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Aktien 100,00 % (31. Dezember 2022: 100,00 %)		
	US-Dollar		
12.622	Achillion Pharmaceuticals Inc*	6.311	100,00
1.356	Clementia Pharmaceuticals Inc†	0	0,00
1.250	Tobira Therapeutics Inc†	0	0,00
	Aktien insgesamt	**6.311**	**100,00**
	Anlagen insgesamt	**6.311**	**100,00**

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**6.311**	**100,00**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**6.311**	**100,00**
Sonstige Nettoverbindlichkeiten	**(6.311)**	**(100,00)**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**0**	**0,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	6.311	5,90
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	0	0,00
Anlagen insgesamt		**6.311**	**5,90**

China A-Share Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert CNY	% des Netto-vermögens
	Aktien 94,84 % (31. Dezember 2022: 94,31 %)		
	Chinesischer Yuan Renminbi		
1.100	Anjoy Foods Group Co Ltd Class A	115.071	0,81
35.200	Baoshan Iron & Steel Co Ltd Class A	208.736	1,47
700	BYD Co Ltd Class A	138.600	0,97
6.300	Centre Testing International Group Co Ltd Class A	89.460	0,63
92.500	China Construction Bank Corp Class A	602.175	4,24
16.800	China Galaxy Securities Co Ltd Class A	202.440	1,42
12.400	China Yangtze Power Co Ltd Class A	289.416	2,04
5.600	Chongqing Department Store Co Ltd Class A	157.920	1,11
6.800	CITIC Securities Co Ltd Class A	138.516	0,97
1.300	Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A	212.238	1,49
9.800	Dongfang Electric Corp Ltd Class A	143.276	1,01
11.900	First Tractor Co Ltd Class A	173.383	1,22
10.500	Fuyao Glass Industry Group Co Ltd Class A	392.595	2,76
3.232	Giantec Semiconductor Corp Class A	197.896	1,39
6.100	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd Class A	162.931	1,15
14.600	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	390.550	2,75
7.120	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals Co Ltd Class A	322.038	2,27
7.000	Jinzai Food Group Co Ltd Class A	85.540	0,60
700	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	1.208.200	8,50
13.800	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	475.410	3,34
600	Luzhou Laojiao Co Ltd Class A	107.652	0,76
11.300	Midea Group Co Ltd Class A	617.319	4,34
12.104	NARI Technology Co Ltd Class A	270.161	1,90
3.501	Piesat Information Technology Co Ltd Class A	147.882	1,04
6.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A	261.950	1,84
24.000	Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A	237.600	1,67
1.800	Proya Cosmetics Co Ltd Class A	178.920	1,26
13.100	Sany Heavy Industry Co Ltd Class A	180.387	1,27
500	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co Ltd Class A	115.365	0,81
4.700	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	296.758	2,09
1.922	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A	558.533	3,93
50.100	Shenzhen MTC Co Ltd Class A	279.558	1,97
8.100	Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A	218.781	1,54
8.200	Shenzhen YUTO Packaging Technology Co Ltd Class A	225.582	1,59
1.800	Sungrow Power Supply Co Ltd Class A	157.662	1,11
10.500	TongFu Microelectronics Co Ltd Class A	242.760	1,71
4.308	Tsingtao Brewery Co Ltd Class A	322.023	2,27
2.700	Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A	207.414	1,46
15.500	Weichai Power Co Ltd Class A	211.575	1,49

China A-Share Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert CNY	% des Nettover-mögens
	Aktien 94,84 % (31. Dezember 2021: 94,31 %) (Fortsetzung)		
	Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung)		
1.975	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	277.112	1,95
5.130	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A	205.405	1,44
13.100	Yizumi Holdings Co Ltd Class A	230.953	1,62
5.900	Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A	147.205	1,04
5.000	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd Class A	147.000	1,03
9.800	Zhejiang Weixing New Building Materials Co Ltd Class A	141.806	1,00
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt	**11.693.754**	**82,27**
	Hongkong-Dollar		
28.000	AK Medical Holdings Ltd	159.838	1,13
78.000	China CITIC Bank Corp Ltd - H Shares	261.751	1,84
24.000	China Life Insurance Co Ltd - H Shares	221.482	1,56
10.000	China Medical System Holdings Ltd	126.207	0,89
50.000	Nexteer Automotive Group Ltd	224.783	1,58
12.000	SciClone Pharmaceuticals Holdings Ltd	152.323	1,07
3.700	Shenzhou International Group Holdings Ltd	271.271	1,91
53.000	Sinotrans Ltd - H Shares	158.041	1,11
400	Tencent Holdings Ltd	107.093	0,75
18.000	Yuexiu Property Co Ltd	104.394	0,73
	Hongkong-Dollar insgesamt	**1.787.183**	**12,57**
	Aktien insgesamt *	**13.480.937**	**94,84**
	Anlagen insgesamt	**13.480.937**	**94,84**

	Zeitwert CNY	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**13.480.937**	**94,84**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**13.480.937**	**94,84**
Sonstiges Nettovermögen	**732.895**	**5,16**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**14.213.832**	**100,00**

Portfolioanalyse	CNY	% des Gesamtver-mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	13.480.937	91,24
Anlagen insgesamt	**13.480.937**	**91,24**

China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert CNY	% des Nettover-mögens
	Einlagenzertifikate 12,76 % (31. Dezember 2022: 20,52 %)				
	Chinesischer Yuan Renminbi				
20.000.000	Agricultural Bank of China Ltd**	2,63 %	23.04.2024	19.502.400	4,25
20.000.000	Bank of Communications Co Ltd*	2,33 %	13.06.2024	19.536.820	4,26
20.000.000	China Citic Bank Corp*	2,49 %	22.05.2024	19.517.780	4,25
	Einlagenzertifikat insgesamt			**58.557.000**	**12,76**
	Unternehmensanleihen 63,24 % (31. Dezember 2022: 60,07 %)				
	Chinesischer Yuan Renminbi				
10.000.000	Agricultural Bank of China Ltd**	4,30 %	11.04.2029	10.054.225	2,19
1.300.000	Bank of Chengdu Co Ltd*	0,40 %	03.03.2028	1.459.432	0,32
20.000.000	Bright Food Group Co Ltd*	3,25 %	12.07.2024	20.077.390	4,37
10.000.000	Central Huijin Investment Ltd**	2,44 %	11.11.2025	9.982.850	2,18
10.000.000	Central Huijin Investment Ltd**	2,80 %	27.10.2026	10.047.720	2,19
10.000.000	China Minmetals Corp**	2,54 %	04.11.2025	9.979.585	2,17
10.000.000	China Post Group Co Ltd*	2,84 %	20.01.2025	10.031.820	2,19
20.000.000	China Resources Inc*	2,90 %	22.04.2025	20.092.520	4,38
2.895.000	China Southern Airlines Co Ltd*	0,80 %	15.10.2026	3.474.174	0,76
20.000.000	China Southern Power Grid Co Ltd**	2,84 %	24.11.2025	20.110.660	4,38
10.000.000	China Three Gorges Renewables Group Co Ltd**	2,65 %	21.02.2025	10.016.095	2,18
840.000	Ecovacs Robotics Co Ltd*	1,00 %	30.11.2027	867.350	0,19
400.000	Great Wall Motor Co Ltd*	0,60 %	10.06.2027	430.832	0,09
950.000	Guangxi LiuYao Group Co Ltd*	1,50 %	16.01.2026	1.117.979	0,24
20.000.000	Guangzhou Yuexiu Holding Ltd**	3,00 %	21.04.2025	20.092.150	4,38
10.000.000	Guotai Junan Securities Co Ltd*	3,16 %	15.02.2026	10.108.760	2,20
1.450.000	Hangzhou First Applied Material Co Ltd*	0,30 %	22.11.2028	1.527.024	0,33
800.000	Hunan Changyuan Lico Co Ltd*	0,50 %	11.10.2028	791.072	0,17
700.000	iRay Technology Co Ltd*	0,40 %	24.10.2028	996.716	0,22
750.000	Lepu Medical Technology Beijing Co Ltd*	1,00 %	30.03.2026	825.015	0,18
3.150.000	LONGi Green Energy Technology Co Ltd*	0,40 %	05.01.2028	3.240.500	0,71
1.700.000	Luxshare Precision Industry Co Ltd*	1,50 %	03.11.2026	1.868.300	0,40
400.000	Ningbo Tuopu Group Co Ltd*	0,40 %	14.07.2028	514.836	0,11
1.000.000	Sailun Group Co Ltd*	0,50 %	02.11.2028	1.349.370	0,30
800.000	Shanying International Holding Co Ltd*	3,00 %	21.11.2024	878.056	0,19
650.000	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd*	0,40 %	18.03.2028	1.177.150	0,26
770.000	Sinocare Inc*	1,50 %	21.12.2026	943.250	0,21
1.080.000	Tongwei Co Ltd*	0,40 %	24.02.2028	1.170.947	0,25
420.000	Wingtech Technology Co Ltd*	0,30 %	28.07.2027	445.041	0,10
800.000	Zhejiang Huahai Pharmaceutical Co Ltd*	1,50 %	02.11.2026	865.016	0,19

China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert CNY	% des Netto-vermögens
	Unternehmensanleihen 63,24 % (31. Dezember 2022: 60,07 %) (Fortsetzung)				
	Chinesischer Yuan Renminbi (Fortsetzung)				
1.100.000	Zheshang Securities Co Ltd*	0,40 %	14.06.2028	1.376.144	0,30
400.000	Zhuzhou Kibing Group Co Ltd*	0,60 %	09.04.2027	437.000	0,10
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt			**176.348.979**	**38,43**
	United States Dollar				
1.000.000	Blossom Joy Ltd*	3,10 %	29.12.2049	6.813.133	1,49
2.000.000	BOC Aviation USA Corp*	1,63 %	29.04.2024	14.061.993	3,07
1.000.000	China Hongqiao Group Ltd*	6,25 %	08.06.2024	7.076.800	1,54
1.000.000	China Mengniu Dairy Co Ltd*	3,00 %	18.07.2024	7.035.046	1,53
1.500.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38 %	12.05.2026	10.022.864	2,19
2.000.000	Guangzhou Metro Investment Finance BVI Ltd**	1,51 %	17.09.2025	13.364.600	2,91
1.000.000	Haitong International Securities Group Ltd**	3,38 %	19.07.2024	7.031.949	1,53
500.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,75 %	29.05.2024	3.512.272	0,77
1.000.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	7.058.295	1,54
500.000	Sands China Ltd**	4,30 %	08.01.2026	3.421.193	0,75
1.000.000	Shanghai Port Group BVI Development 2 Co Ltd*	1,50 %	13.07.2025	6.750.649	1,47
1.300.000	Sinochem Offshore Capital Co Ltd*	1,00 %	23.09.2024	8.964.266	1,95
697.000	Studio City Finance Ltd**	6,00 %	15.07.2025	4.863.225	1,06
1.000.000	Tencent Holdings Ltd*	3,98 %	11.04.2029	6.779.456	1,48
1.000.000	TFI Overseas Investment Ltd*	6,50 %	05.06.2024	7.049.394	1,53
	US-Dollar insgesamt			**113.805.135**	**24,81**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**290.154.114**	**63,24**
	Staatsanleihen 20,89 % (31. Dezember 2022: 13,26 %)				
	Chinesischer Yuan Renminbi				
30.000.000	China Government Bond	2,18 %	15.08.2026	29.923.935	6,52
9.500.000	China Government Bond	2,39 %	15.11.2026	9.527.654	2,08
46.000.000	China Government Bond	2,67 %	25.05.2033	46.311.328	10,09
10.000.000	China Government Bond	2,69 %	12.08.2026	10.095.765	2,20
	Staatsanleihen insgesamt **			**95.858.682**	**20,89**
	Anlagen insgesamt			**444.569.796**	**96,89**

Devisenterminkontrakte 0,42 % (31. Dezember 2022: 0,87 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn CNY	% des Nettover-mögens
88.647.125 CNY	12.250.000 US$	25.03.2024	Citibank NA	1	1.917.777	0,42
4.624.724 CNY	650.000 US$	25.03.2024	Standard Chartered Bank	1	22.759	0,00
500.000 US$	3.554.265 CNY	19.01.2024	Standard Chartered Bank	1	1.897	0,00

China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,42 % (31. Dezember 2022: 0,87 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn CNY	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen GBP						
20.808 £	186.698 CNY	14.03.2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.318	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**1.943.751**	**0,42**

Futures-Kontrakte 0,13 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn CNY	% des Nettover-mögens
35	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	603.582	0,13
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**603.582**	**0,13**

	Zeitwert CNY	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**447.117.129**	**97,44**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,51 %) (31. Dezember 2022: (0,60 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust CNY	% des Nettover-mögens
10.719.177 CNY	1.518.183 US$	19.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(78.634)	(0,02)
47.256.298 CNY	6.699.125 US$	19.01.2024	UBS AG	1	(390.056)	(0,08)
3.708.407 US$	26.709.116 CNY	19.01.2024	Citibank NA	4	(333.720)	(0,07)
736.224 US$	5.343.470 CNY	25.03.2024	Standard Chartered Bank	1	(131.043)	(0,03)
Abgesicherte Klassen EUR						
2.816 CNY	365 €	18.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(56)	(0,00)
Abgesicherte Klassen USD						
49.144.920 US$	349.647.976 CNY	14.03.2024	UBS AG	2	(1.428.436)	(0,31)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(2.361.945)**	**(0,51)**

	Zeitwert CNY	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(2.361.945)**	**(0,51)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**444.755.184**	**96,93**
Sonstiges Nettovermögen	**14.090.924**	**3,07**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**458.846.108**	**100,00**

China Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

	Portfolioanalyse	**CNY**	**% des Gesamtvermögens**
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	210.244.462	45,47
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	234.325.334	50,67
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	603.582	0,13
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(418.194)	(0,09)
Anlagen insgesamt		**444.755.184**	**96,18**

China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 96,46 % (31. Dezember 2022: 96,67 %)		
	Chinesischer Yuan Renminbi		
1.300.072	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	4.883.988	2,74
200.000	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd Class A	1.535.826	0,86
2.649.953	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	12.820.673	7,19
1.150.031	Midea Group Co Ltd Class A	8.823.160	4,95
154.414	Milkyway Chemical Supply Chain Service Co Ltd Class A	1.153.887	0,65
5.395.916	Satellite Chemical Co Ltd Class A	11.177.395	6,27
729.058	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd Class A	2.824.862	1,59
370.127	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	3.282.001	1,84
475.035	Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A	1.801.912	1,01
220.471	Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A	4.009.943	2,25
775.059	Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A	8.361.659	4,69
700.094	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	5.586.515	3,14
310.200	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A	1.920.726	1,08
6.806.103	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A	6.241.588	3,50
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt	**74.424.135**	**41,76**
	Hongkong-Dollar		
1.304.000	Akeso Inc	7.748.634	4,35
800.000	Alibaba Group Holding Ltd	7.745.356	4,34
1.300.000	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	4.528.370	2,54
3.767.600	China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares	7.604.149	4,27
1.976.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	8.654.513	4,86
1.370.000	China Resources Land Ltd	4.912.564	2,76
23.000	Cowell e Holdings Inc	67.894	0,04
7.000.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	6.508.251	3,65
3.500.000	Haier Smart Home Co Ltd - H Shares	9.883.397	5,54
550.000	Meituan Class B	5.768.677	3,24
151.500	Shenzhou International Group Holdings Ltd	1.559.905	0,87
499.000	SITC International Holdings Co Ltd	861.430	0,48
272.500	Tencent Holdings Ltd	10.245.948	5,75
340.000	Zhongsheng Group Holdings Ltd	813.365	0,46
	Hongkong-Dollar insgesamt	**76.902.453**	**43,15**
	US-Dollar		
320.311	Trip.com Group Ltd ADR	11.534.399	6,47
425.534	ZTO Express Cayman Inc ADR	9.055.364	5,08
	US-Dollar insgesamt	**20.589.763**	**11,55**
	Aktien insgesamt *	**171.916.351**	**96,46**
	Anlagen insgesamt	**171.916.351**	**96,46**

China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,31 % (31. Dezember 2022: 0,35 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen CHF						
2.970 CHF	3.295 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	240	0,00
12.468 CHF	14.066 US$	18.01.2024	UBS AG	5	772	0,00
307.640 CHF	344.184 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	9	21.932	0,01
1.184 US$	994 CHF	18.01.2024	UBS AG	1	1	0,00
Abgesicherte Klassen EUR						
105.852 €	115.048 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	1.954	0,00
4.179.735 €	4.454.604 US$	18.01.2024	UBS AG	4	165.414	0,10
4.235.456 €	4.511.673 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	11	169.935	0,10
12.522 US$	11.302 €	18.01.2024	UBS AG	1	30	0,00
77.807 US$	70.020 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	411	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
407 £	505 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	14	0,00
11.341 £	13.932 US$	18.01.2024	UBS AG	4	527	0,00
1.197 £	1.478 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	8	47	0,00
216 US$	169 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	1	0,00
Abgesicherte Klassen SGD						
8.081.356 SGD	5.947.663 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	183.234	0,10
40.041 SGD	30.143 US$	18.01.2024	UBS AG	2	234	0,00
157.764 SGD	117.215 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	9	2.474	0,00
8.140 US$	10.730 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	0	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞]					**547.220**	**0,31**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**172.463.571**	**96,77**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (0,26 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen CHF						
5.382 CHF	6.422 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(17)	(0,00)
10.023 US$	8.866 CHF	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	(528)	(0,00)
43.219 US$	37.998 CHF	18.01.2024	UBS AG	16	(2.002)	(0,00)
130.948 US$	116.394 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	6	(7.571)	(0,01)
Abgesicherte Klassen EUR						
60.632 €	67.093 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(74)	(0,00)
176.076 US$	162.208 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	(3.218)	(0,00)

China Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,26 %) (31. Dezember 2021: (0,05 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)						
3.431.985 US$	3.218.073 €	18.01.2024	UBS AG	7	(125.073)	(0,07)
3.573.281 US$	3.352.868 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	29	(132.773)	(0,08)
Abgesicherte Klassen GBP						
342 £	436 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
1.338 US$	1.082 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	9	(42)	(0,00)
566 US$	458 £	18.01.2024	UBS AG	3	(19)	(0,00)
1.545 US$	1.235 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	12	(29)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SGD						
48.386 SGD	36.714 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(6)	(0,00)
4.744.618 US$	6.446.588 SGD	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(146.066)	(0,08)
104.825 US$	141.070 SGD	18.01.2024	UBS AG	9	(2.199)	(0,00)
191.730 US$	257.640 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	22	(3.727)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(423.344)**	**(0,24)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(423.344)**	**(0,24)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**172.040.227**	**96,53**
Sonstiges Nettovermögen	**6.186.060**	**3,47**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**178.226.287**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	171.916.351	95,78
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	123.876	0,07
Anlagen insgesamt		**172.040.227**	**95,85**

Climate Innovation – Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 96,88 %		
	Chinesischer Yuan Renminbi		
1.000	Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A	22.928	0,78
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt	**22.928**	**0,78**
	Euro		
513	Arkema SA	58.369	2,00
843	Danone SA	54.644	1,87
1.272	DSM-Firmenich AG	129.270	4,42
5.339	Iberdrola SA	70.006	2,39
4.762	Stellantis NV	111.256	3,81
	Euro insgesamt	**423.545**	**14,49**
	Hongkong-Dollar		
3.000	BYD Co Ltd - H Shares	82.371	2,82
1.300	Li Auto Inc Class A	24.490	0,84
	Hongkong-Dollar insgesamt	**106.861**	**3,66**
	Japanischer Yen		
1.200	Hitachi Ltd	86.566	2,96
	Japanischer Yen insgesamt	**86.566**	**2,96**
	Norwegische Krone		
5.262	Aker Carbon Capture ASA	7.036	0,24
	Norwegische Krone insgesamt	**7.036**	**0,24**
	Britisches Pfund		
1.320	CRH Plc	91.036	3,12
	Britisches Pfund insgesamt	**91.036**	**3,12**
	Südkoreanischer Won		
1.576	Kia Corp	121.877	4,17
301	L&F Co Ltd	47.247	1,61
116	LG Chem Ltd	44.616	1,53
44	LG Energy Solution Ltd	14.521	0,50
	Südkoreanischer Won insgesamt	**228.261**	**7,81**
	Schweizer Franken		
1.342	ABB Ltd	59.474	2,04
	Schweizer Franken insgesamt	**59.474**	**2,04**

Climate Innovation – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 96,88 % (Fortsetzung)		
	US-Dollar		
65	Adobe Inc	38.779	1,33
178	Applied Materials Inc	28.848	0,99
324	Autoliv Inc	35.701	1,22
89	Builders FirstSource Inc	14.858	0,51
97	Cadence Design Systems Inc	26.420	0,90
322	Clean Harbors Inc	56.192	1,92
790	Copart Inc	38.710	1,32
96	DR Horton Inc	14.590	0,50
299	Emerson Electric Co	29.102	1,00
5.164	GFL Environmental Inc	178.210	6,10
3.130	Green Plains Inc	78.939	2,70
2.941	Howmet Aerospace Inc	159.167	5,45
1.250	Ingersoll Rand Inc	96.675	3,31
186	ITT Inc	22.193	0,76
1.101	NEXTracker Inc Class A	51.582	1,76
3.044	nVent Electric Plc	179.870	6,15
675	ON Semiconductor Corp	56.383	1,93
2.328	Procore Technologies Inc	161.144	5,51
735	Quanta Services Inc	158.613	5,43
1.936	Sunnova Energy International Inc	29.524	1,01
1.798	Sunrun Inc	35.295	1,21
49	Synopsys Inc	25.231	0,86
479	Trane Technologies Plc	116.828	4,00
221	Union Pacific Corp	54.282	1,86
271	Veralto Corp	22.292	0,76
504	Wolfspeed Inc	21.929	0,75
650	Xylem Inc	74.334	2,54
	US-Dollar insgesamt	**1.805.691**	**61,78**
	Aktien insgesamt *	**2.831.398**	**96,88**
	Anlagen insgesamt	**2.831.398**	**96,88**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**2.831.398**	**96,88**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**2.831.398**	**96,88**
Sonstiges Nettovermögen	**91.157**	**3,12**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**2.922.555**	**100,00**

Climate Innovation – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	2.831.398	95,75
Anlagen insgesamt	**2.831.398**	**95,75**

CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Schatzwechsel 2,69 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
	US-Dollar				
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	09.01.2024	4.994.906	2,69
	Schatzwechsel insgesamt **			**4.994.906**	**2,69**
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 86,02 % (31. Dezember 2022: 81,77 %)				
	Euro				
1.750.000	Adagio X Eur CLO DAC Series X-X Class ER	12,26 %	20.10.2037	1.948.501	1,05
1.400.000	Aqueduct European CLO 7-2022 DAC Series 2022-7X Class E	11,12 %	15.03.2036	1.565.014	0,84
1.000.000	Arbour CLO VI DAC Series 6X Class E	9,78 %	15.11.2031	1.063.471	0,57
1.000.000	Ares European CLO X DAC Series 10X Class F	11,04 %	15.10.2031	983.600	0,53
1.050.000	Armada Euro CLO I DAC Series 1X Class ER	10,06 %	24.10.2033	1.132.849	0,61
1.500.000	Armada Euro CLO V DAC Series 5X Class E	9,92 %	28.07.2034	1.583.171	0,85
3.000.000	Aurium CLO III DAC Series 3X Class E	8,87 %	16.04.2030	3.166.148	1,71
1.200.000	Aurium CLO VI DAC Series 6X Class ER	10,00 %	22.05.2034	1.269.687	0,68
1.500.000	Avoca CLO XIII DAC Series 13X Class ERR	10,16 %	15.04.2034	1.590.619	0,86
1.400.000	Avoca CLO XXVI Designated Activity Co Series 26X Class F	13,06 %	15.04.2035	1.440.736	0,78
1.500.000	Avoca Static CLO I DAC Series 1X Class E	10,97 %	15.10.2030	1.656.443	0,89
3.100.000	BlackRock European CLO XIV DAC Series 14X Class E	11,61 %	15.07.2036	3.410.638	1,84
1.000.000	BlackRock European CLO XIV DAC Series 14X Class F	14,16 %	15.07.2036	1.116.044	0,60
1.000.000	Contego CLO XII DAC Series 12X Class E	11,97 %	25.01.2038	1.102.536	0,59
1.700.000	CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class E	11,22 %	25.04.2036	1.871.805	1,01
1.500.000	CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class F	13,32 %	25.04.2036	1.569.368	0,84
2.250.000	CVC Cordatus Loan Fund XXVI DAC Series 26X Class E	12,36 %	15.01.2037	2.531.838	1,36
1.400.000	CVC Cordatus Loan Fund XXVII DAC Series 27X Class F	14,32 %	15.04.2035	1.565.290	0,84
3.000.000	Euro-Galaxy VII CLO DAC Series 2019-7X Class ER	10,16 %	25.07.2035	3.159.758	1,70
1.500.000	Goldentree Loan Management EUR CLO 3 DAC Series 3X Class E	9,88 %	20.01.2032	1.583.653	0,85
2.750.000	Goldentree Loan Management EUR CLO 4 DAC Series 4X Class ER	10,04 %	20.07.2034	2.924.714	1,58
1.500.000	Goldentree Loan Management EUR CLO 5 DAC Series 5X Class E	9,22 %	20.04.2034	1.551.385	0,84
1.000.000	Margay CLO I DAC Series 1X Class E	12,29 %	15.07.2036	1.124.480	0,61
1.251.000	OCP Euro CLO 2029-3 Ltd Series 2019-3X Class ER	9,99 %	20.04.2033	1.303.424	0,70
1.485.000	Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E	11,05 %	15.05.2035	1.600.289	0,86
1.150.000	Otranto Park CLO DAC Series 1X Class F	13,05 %	15.05.2035	1.188.000	0,64
1.000.000	Palmer Square European CLO 2022-1 DAC Series 2022-1X Class F	12,85 %	21.01.2035	1.015.725	0,55
2.000.000	Palmer Square European Loan Funding 2023-1 DAC Series 2023-1X Class E	10,53 %	15.11.2032	2.154.184	1,16
1.650.000	Vesey Park CLO DAC Series 1X Class E	13,88 %	16.11.2032	1.779.418	0,96
1.300.000	Voya Euro CLO IV DAC Series 4X Class FR	12,69 %	15.10.2034	1.328.083	0,72
	Euro insgesamt			**51.280.871**	**27,62**

CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 86,02 % (31. Dezember 2022: 81,77 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar				
2.000.000	AB BSL CLO 1 Ltd Series 2020-1X Class ER	12,17 %	15.01.2035	1.970.196	1,06
1.000.000	AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3A Class E	12,63 %	20.10.2034	962.016	0,52
1.000.000	AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3X Class E	12,53 %	20.10.2034	962.016	0,52
2.500.000	AB BSL CLO 4 Ltd Series 2023-4X Class E	13,48 %	20.04.2036	2.521.970	1,36
3.800.000	AGL CLO 22 Ltd Series 2022-22X Class E	13,95 %	20.10.2035	3.824.500	2,06
1.000.000	AGL CLO 25 Ltd Series 2023-25X Class E	13,98 %	21.07.2036	1.024.127	0,55
1.500.000	Aimco CLO Series 2017-A Series 2017-AX Class FR	14,12 %	20.04.2034	1.192.705	0,64
2.000.000	Apidos CLO XX Series 2015-20X Class DR	11,28 %	16.07.2031	1.883.186	1,01
2.100.000	Apidos CLO XXIV Series 2016-24X Class DR	11,38 %	20.10.2030	1.986.467	1,07
3.000.000	Apidos CLO XXXIV Series 2020-34X Class ER	12,08 %	20.01.2035	2.983.239	1,61
1.000.000	Ares XLIX CLO Ltd Series 2018-49X Class E	11,37 %	22.07.2030	950.748	0,51
2.000.000	Ares XXXVII CLO Ltd Series 2015-4X Class DR	11,73 %	15.10.2030	1.915.334	1,03
4.000.000	Assurant CLO I Ltd Series 2018-2X Class E	11,73 %	20.10.2031	3.768.831	2,03
1.000.000	Bain Capital Credit CLO 2023-2 Ltd Series 2023-2X Class E	13,78 %	18.07.2036	1.008.953	0,54
1.500.000	Bain Capital Credit CLO 2023-4 Ltd Series 2023-4X Class E	13,58 %	21.10.2036	1.520.116	0,82
2.825.000	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class D	11,38 %	20.04.2031	2.679.606	1,44
3.000.000	Bayswater Park CLO Ltd Series 2023-1X Class E	12,74 %	20.01.2037	2.984.526	1,61
2.200.000	Benefit Street Partners CLO XXXIII Ltd Series 2023-33X Class E	7,64 %	25.01.2036	2.178.000	1,17
2.500.000	Canyon Capital CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class E	13,39 %	15.10.2036	2.540.120	1,37
3.000.000	Carlyle Global Market Strategies Series 2014-2RX Class D	10,99 %	15.05.2031	2.783.266	1,50
4.000.000	Cifc Funding 2018-I Ltd Series 2018-1X Class E	10,56 %	18.04.2031	3.734.563	2,01
3.000.000	Dryden 60 CLO Ltd Series 2018-60X Class E	11,18 %	15.07.2031	2.858.506	1,54
2.135.000	Dryden XXVIII Senior Loan Fund Series 2013-28X Class B2LR	12,10 %	15.08.2030	2.017.926	1,09
1.250.000	Eaton Vance CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class ER	11,18 %	20.01.2030	1.128.097	0,61
2.000.000	Eaton Vance CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class E	11,58 %	15.10.2030	1.882.433	1,01
4.000.000	Galaxy XXV CLO Ltd Series 2018-25X Class E	11,59 %	25.10.2031	3.853.857	2,08
4.400.000	Goldentree Loan Management US CLO 14 Ltd Series 2022-14X Class E	13,15 %	20.07.2035	4.433.084	2,39
3.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 18 Ltd Series 2023-18X Class E	12,93 %	20.01.2037	2.983.912	1,61
1.588.000	Goldentree Loan Management US CLO 4 Ltd Series 2019-4X Class F	12,06 %	24.04.2031	1.278.367	0,69
1.400.000	Goldentree Loan Management US CLO 5 Ltd Series 2019-5X Class F	12,15 %	20.10.2032	1.195.849	0,64
1.000.000	Invesco US CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class E	13,77 %	22.04.2035	1.008.304	0,54
750.000	KKR CLO 17 Ltd Series 17X Class E	12,97 %	15.04.2034	708.283	0,38
1.702.500	Madison Park Funding XXX Ltd Series 2018-30X Class E	10,53 %	15.04.2029	1.636.041	0,88
3.300.000	Magnetite CLO Ltd Series 2015-14RX Class E	11,16 %	18.10.2031	3.235.978	1,74
1.650.000	Magnetite VII Ltd Series 2012-7X Class ER2	12,08 %	15.01.2028	1.555.000	0,84
2.650.000	Magnetite VIII Ltd Series 2014-8X Class FR2	13,02 %	15.04.2031	2.366.416	1,28
2.490.000	Magnetite XVII Ltd Series 2016-18X Class FR	13,24 %	15.11.2028	2.340.503	1,26

CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 86,02 % (31. Dezember 2022: 81,77 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
2.000.000	Mariner CLO 5 Ltd Series 2018-5X Class E	11,29 %	25.04.2031	1.874.987	1,01
1.500.000	MidOcean Credit CLO XI Ltd Series 2022-11X Class ER	13,68 %	18.10.2033	1.468.342	0,79
1.500.000	OCP CLO 2023-26 Ltd Series 2023-26X Class E	13,57 %	17.04.2036	1.505.465	0,81
2.000.000	Post CLO 2018-1 Ltd Series 2018-1X Class E	11,45 %	16.04.2031	1.898.845	1,02
2.000.000	PPM CLO 3 Ltd Series 2019-3X Class E	12,19 %	17.04.2034	1.880.042	1,01
2.200.000	Symphony CLO 35 Ltd Series 2022-35X Class ER	12,90 %	24.10.2036	2.209.482	1,19
3.000.000	Symphony CLO 37 Ltd Series 2022-37X Class ER	13,31 %	20.01.2037	2.986.379	1,61
2.000.000	Symphony CLO 40 Ltd Series 2023-40X Class E	13,13 %	14.01.2034	2.020.192	1,09
4.000.000	Trestles CLO II Ltd Series 2018-2X Class D	11,39 %	25.07.2031	3.874.372	2,09
1.000.000	Trestles CLO Ltd Series 2021-18X Class E	12,73 %	20.01.2035	956.005	0,52
2.000.000	Trinitas CLO VII Ltd Series 2017-7X Class ER	12,74 %	25.01.2035	1.860.981	1,00
1.675.000	Trinitas CLO X Ltd Series 2019-10X Class ER	12,68 %	15.01.2035	1.447.718	0,78
1.000.000	Trinitas CLO XVII Ltd Series 2021-17X Class E	12,61 %	20.10.2034	947.194	0,51
2.000.000	Voya CLO 2022-3 Ltd Series 2022-3X Class ER	13,42 %	20.10.2036	2.013.667	1,09
1.600.000	Wellington Management CLO 1 Ltd Series 2023-1X Class E	13,05 %	20.10.2036	1.605.492	0,87
	US-Dollar insgesamt			**108.406.204**	**58,40**
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **			**159.687.075**	**86,02**

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Investmentfonds 6,58 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)		
	US-Dollar		
131.071	iShares USD High Yield Corporate Bond UCITS ETF	12.221.060	6,58
	Investmentfonds insgesamt ‡	**12.221.060**	**6,58**
	Anlagen insgesamt	**176.903.041**	**95,29**

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 2,37 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
1.017.894 €	1.106.815 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	18.301	0,01
189.266 €	200.264 US$	18.01.2024	UBS AG	1	8.939	0,00
40.853.941 €	43.731.412 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	12	1.425.985	0,77
Abgesicherte Klassen GBP						
383 £	470 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	18	0,00
7.222.743 £	8.871.789 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	336.571	0,18
7.223.098 £	8.864.237 US$	18.01.2024	UBS AG	2	344.576	0,19
3.327 £	4.157 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	8	84	0,00
Abgesicherte Klassen SEK						
15.085.883 SEK	1.389.818 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	108.072	0,06
544.789 SEK	52.779 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	1.314	0,00

CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 2,37 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen SEK (Fortsetzung)						
166.133 SEK	16.186 US$	18.01.2024	UBS AG	1	309	0,00
14.531.738 SEK	1.341.747 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	101.120	0,05
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**2.345.289**	**1,26**

Total Return Swap-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Nominalwert		Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
USD	5.000.000	20.03.2024	5,38[1]	iBoxx USD Liquid High Yield Index[2]	48.732	0,03
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten ∞					**48.732**	**0,03**

[1] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

[2] Kontrahent für diese Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**179.297.062**	**96,58**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,38 %) (31. Dezember 2022: (0,72 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
34.818.167 US$	32.901.543 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(1.549.145)	(0,83)
9.421.963 US$	8.821.000 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	5	(328.220)	(0,18)
Abgesicherte Klassen EUR						
245.213 €	271.693 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(650)	(0,00)
179.200 US$	168.515 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(7.066)	(0,00)
257.470 US$	238.346 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(5.984)	(0,00)
Abgesicherte Klassen GBP						
8.835.056 US$	7.192.837 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(335.177)	(0,18)
8.827.086 US$	7.192.837 £	18.01.2024	UBS AG	1	(343.147)	(0,19)
372 US$	304 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(16)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SEK						
178.860 SEK	17.936 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(177)	(0,00)
13.638 US$	149.159 SEK	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(1.172)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(2.570.754)**	**(1,38)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(2.570.754)**	**(1,38)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**176.726.308**	**95,20**
Sonstiges Nettovermögen	**8.919.997**	**4,80**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**185.646.305**	**100,00**

CLO Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

	Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtvermögens
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	164.681.981	84,21
µ	Investmentfonds	12.221.060	6,25
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(176.733)	(0,09)
Anlagen insgesamt		**176.726.308**	**90,37**

Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Schatzwechsel 28,60 % (31. Dezember 2022: 45,88 %)				
	US-Dollar				
9.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	16.01.2024	8.981.616	5,85
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	23.01.2024	4.984.649	3,24
10.135.000	United States Treasury Bill	0,00 %	25.01.2024	10.100.891	6,57
10.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	01.02.2024	9.956.098	6,48
10.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	27.02.2024	9.917.907	6,46
	Schatzwechsel insgesamt **			**43.941.161**	**28,60**
	Unternehmensanleihen 50,14 % (31. Dezember 2022: 30,49 %)				
	US-Dollar				
1.240.000	AbbVie Inc*	2,60 %	21.11.2024	1.211.975	0,79
1.545.000	AbbVie Inc**	3,85 %	15.06.2024	1.533.263	1,00
2.845.000	Amazon.com Inc**	0,45 %	12.05.2024	2.795.467	1,82
3.000.000	American Express Co**	6,34 %	04.03.2025	3.007.534	1,96
2.299.000	Amgen Inc**	3,63 %	22.05.2024	2.281.141	1,48
1.400.000	Analog Devices Inc**	5,69 %	01.10.2024	1.400.192	0,91
2.945.000	Apple Inc**	3,00 %	09.02.2024	2.936.451	1,91
3.711.000	AT&T Inc*	0,90 %	25.03.2024	3.670.591	2,39
3.775.000	Bank of America Corp**	6,48 %	25.04.2025	3.780.957	2,46
20.000	Bank of New York Mellon Corp**	5,58 %	25.10.2024	19.966	0,01
1.390.000	Bristol-Myers Squibb Co**	2,90 %	26.07.2024	1.371.592	0,89
330.000	Capital One Financial Corp**	6,75 %	09.05.2025	329.870	0,21
545.000	Caterpillar Financial Services Corp**	5,65 %	17.05.2024	544.968	0,35
1.605.000	Caterpillar Financial Services Corp**	5,69 %	13.09.2024	1.605.149	1,05
880.000	Citibank NA**	3,65 %	23.01.2024	879.054	0,57
145.000	Citigroup Inc**	6,78 %	24.05.2025	145.384	0,09
2.915.000	Citigroup Inc**	6,96 %	17.03.2026	2.935.681	1,91
2.000.000	Corebridge Global Funding**	0,65 %	17.06.2024	1.953.099	1,27
40.000	Enbridge Inc**	6,03 %	16.02.2024	40.012	0,03
3.397.000	Enterprise Products Operating LLC*	3,90 %	15.02.2024	3.389.516	2,21
400.000	Florida Power & Light Co**	5,75 %	12.01.2024	399.999	0,26
1.360.000	General Motors Financial Co Inc*	1,05 %	08.03.2024	1.347.942	0,88
3.082.000	Goldman Sachs Group Inc*	5,70 %	01.11.2024	3.091.203	2,01
1.175.000	John Deere Capital Corp**	5,56 %	11.10.2024	1.175.145	0,77
10.000	John Deere Capital Corp**	5,97 %	07.03.2025	10.034	0,01
3.938.000	JPMorgan Chase & Co**	6,01 %	23.06.2025	3.931.456	2,56
765.000	Microsoft Corp**	2,88 %	06.02.2024	763.146	0,50
3.665.000	Morgan Stanley**	6,01 %	24.01.2025	3.660.147	2,38
2.075.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp**	5,70 %	18.10.2024	2.077.168	1,35
3.755.000	Oracle Corp*	3,40 %	08.07.2024	3.712.126	2,42

Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 50,14 % (31. Dezember 2022: 30,49 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.540.000	PepsiCo Inc**	5,80 %	13.02.2026	1.540.214	1,00
2.000.000	Protective Life Global Funding**	6,42 %	28.03.2025	2.007.679	1,31
1.729.000	Royal Bank of Canada**	5,82 %	21.01.2025	1.724.635	1,12
2.095.000	Simon Property Group LP*	2,00 %	13.09.2024	2.048.415	1,33
1.425.000	Simon Property Group LP*	3,75 %	01.02.2024	1.422.651	0,93
55.000	Starbucks Corp**	5,82 %	14.02.2024	55.000	0,04
1.185.000	Toyota Motor Credit Corp**	6,05 %	22.03.2024	1.185.891	0,77
1.240.000	Truist Bank**	5,57 %	17.01.2024	1.239.809	0,81
240.000	Truist Financial Corp**	5,82 %	09.06.2025	236.478	0,15
2.415.000	US Bancorp*	2,40 %	30.07.2024	2.374.249	1,55
1.565.000	Verizon Communications Inc*	0,75 %	22.03.2024	1.548.374	1,01
2.000.000	Volkswagen Group of America Finance LLC**	6,37 %	07.06.2024	2.002.945	1,30
3.650.000	Wells Fargo & Co*	3,75 %	24.01.2024	3.645.228	2,37
	Unternehmensanleihen insgesamt			**77.031.796**	**50,14**
	Anlagen insgesamt			**120.972.957**	**78,74**

Devisenterminkontrakte 1,02 % (31. Dezember 2022: 1,77 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen GBP						
30.117.998 £	36.992.612 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	4	1.405.179	0,91
2.213.057 £	2.779.018 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	7	42.435	0,03
3.901.557 £	4.848.536 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	60	125.607	0,08
247.634 US$	194.104 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	167	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**1.573.388**	**1,02**

Total Return Swap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
USD 150.965.727	28.03.2024	0,00[1]	Goldman Sachs i-Select Strategy 1168 Index[2]	0	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten ∞				**0**	**0,00**

[1] Fester Zinssatz.

[2] Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**122.546.345**	**79,76**

Commodities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,14 %) (31. Dezember 2022: (0,39 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen GBP						
321.032 £	409.785 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(499)	(0,00)
1.589.953 US$	1.289.648 £	18.01.2024	Standard Chartered Bank	4	(54.235)	(0,04)
761.106 US$	608.276 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(14.392)	(0,01)
4.951.276 US$	3.994.220 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	54	(141.000)	(0,09)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(210.126)**	**(0,14)**

Total Return Swap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

Nominalwert		Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
USD	1.041.658	28.03.2024	0,00[1]	Goldman Sachs i-Select Strategy 1168 Index[2]	(0)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten ∞					**(0)**	**(0,00)**

[1] Fester Zinssatz.

[2] Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(210.126)**	**(0,14)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**122.336.219**	**79,62**
Sonstiges Nettovermögen	**31.310.340**	**20,38**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**153.646.559**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	27.462.270	16,71
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	93.510.687	56,90
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	1.363.262	0,83
Anlagen insgesamt		**122.336.219**	**74,44**

Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Netto-vermögens
	Unternehmensanleihen 93,25 % (31. Dezember 2022: 91,91 %)				
	Euro				
200.000	Accor SA*	7,25 %	29.12.2049	218.094	0,01
37.000.000	APA Infrastructure Ltd*	7,13 %	09.11.2083	38.946.718	2,08
700.000	Arkema SA*	1,50 %	29.12.2049	650.352	0,03
2.500.000	Arkema SA*	2,75 %	29.12.2049	2.477.875	0,13
48.104.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd*	1,63 %	11.03.2081	43.523.697	2,33
40.400.000	Bayer AG*	6,63 %	25.09.2083	41.273.852	2,21
37.300.000	Bayer AG*	7,00 %	25.09.2083	38.599.569	2,06
100.000	Bertelsmann SE & Co KGaA*	3,50 %	23.04.2075	95.693	0,01
16.169.000	BP Capital Markets Plc*	3,25 %	29.12.2049	15.655.473	0,84
49.080.000	BP Capital Markets Plc*	3,63 %	29.12.2049	46.093.089	2,47
5.194.000	British Telecommunications Plc*	1,87 %	18.08.2080	4.968.321	0,27
100.000	EDP - Energias de Portugal SA*	1,88 %	14.03.2082	84.532	0,00
15.000.000	Electricite de France SA*	7,50 %	29.12.2049	16.413.120	0,88
44.500.000	Elia Group SA*	5,85 %	29.12.2049	45.337.490	2,42
41.500.000	ELM BV for Firmenich International SA*	3,75 %	29.12.2049	40.771.675	2,18
20.600.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,38 %	31.08.2081	17.630.201	0,94
17.700.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,88 %	29.06.2080	16.564.899	0,89
10.200.000	Enel SpA*	1,38 %	29.12.2049	8.937.240	0,48
21.600.000	Enel SpA*	6,38 %	29.12.2049	22.644.079	1,21
3.100.000	Engie SA*	1,63 %	29.12.2049	2.987.749	0,16
100.000	Eni SpA*	3,38 %	29.12.2049	92.003	0,00
100.000	Evonik Industries AG*	1,38 %	02.09.2081	88.915	0,00
36.371.000	Heimstaden Bostad AB*	2,63 %	29.12.2049	12.736.760	0,68
16.860.000	Heimstaden Bostad AB*	3,25 %	29.12.2049	8.838.855	0,47
6.714.000	Heimstaden Bostad AB*	3,38 %	29.12.2049	2.851.033	0,15
20.500.000	Iberdrola Finanzas SA*	4,88 %	29.12.2049	20.716.787	1,11
20.000.000	Iberdrola International BV*	1,45 %	29.12.2049	18.235.500	0,98
8.900.000	Iberdrola International BV*	1,87 %	29.12.2049	8.400.844	0,45
100.000	Infineon Technologies AG*	3,63 %	29.12.2049	96.270	0,01
32.166.000	Koninklijke FrieslandCampina NV*	2,85 %	29.12.2049	29.724.697	1,59
3.600.000	Orange SA*	2,38 %	29.12.2049	3.507.768	0,19
10.940.000	Orange SA*	5,00 %	29.12.2049	11.192.878	0,60
3.000.000	Orange SA*	5,25 %	29.12.2049	3.005.625	0,16
20.000.000	Orange SA*	5,38 %	29.12.2049	20.982.880	1,12
9.854.000	Orsted AS*	1,75 %	29.12.2049	8.662.149	0,46
25.000.000	Orsted AS*	5,25 %	29.12.2049	25.074.600	1,34
100.000	Redeia Corp SA*	4,63 %	29.12.2049	102.014	0,01
10.000.000	Repsol International Finance BV*	3,75 %	29.12.2049	9.812.500	0,52

Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 93,25 % (31. Dezember 2022: 91,91 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
94.973.000	Southern Co*	1,88 %	15.09.2081	81.689.340	4,37
19.358.000	SSE Plc*	3,13 %	29.12.2049	18.415.072	0,98
36.405.000	SSE Plc*	4,00 %	29.12.2049	35.369.096	1,89
19.875.000	Stedin Holding NV*	1,50 %	29.12.2049	17.899.306	0,96
100.000	Syensqo SA*	2,50 %	29.12.2049	95.152	0,01
10.000.000	Telefonica Europe BV*	6,75 %	29.12.2049	10.702.370	0,57
15.000.000	Telefonica Europe BV*	7,13 %	29.12.2049	16.228.725	0,87
9.185.000	Telia Co AB*	1,38 %	11.05.2081	8.553.531	0,46
100.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale*	2,38 %	29.12.2049	89.803	0,00
30.944.000	TotalEnergies SE*	1,63 %	29.12.2049	27.761.750	1,48
12.045.000	TotalEnergies SE*	2,63 %	29.12.2049	11.789.044	0,63
45.000.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE*	7,25 %	29.12.2049	45.164.033	2,42
26.500.000	Veolia Environnement SA*	2,00 %	29.12.2049	23.780.438	1,27
48.800.000	Veolia Environnement SA*	2,25 %	29.12.2049	46.206.719	2,47
30.100.000	Veolia Environnement SA*	5,99 %	29.12.2049	31.699.273	1,70
38.000.000	Vodafone Group Plc*	6,50 %	30.08.2084	40.727.906	2,18
83.700.000	Volkswagen International Finance NV*	7,50 %	29.12.2049	91.213.498	4,88
	Euro insgesamt			**1.095.380.852**	**58,58**
	Britisches Pfund				
23.993.000	BP Capital Markets Plc*	4,25 %	29.12.2049	26.068.594	1,40
46.600.000	British Telecommunications Plc*	8,38 %	20.12.2083	56.919.528	3,04
62.536.000	Centrica Plc*	5,25 %	10.04.2075	71.449.200	3,82
76.600.000	Electricite de France SA*	6,00 %	29.12.2049	86.297.261	4,62
100.000	Mobico Group Plc*	4,25 %	29.12.2049	102.179	0,01
108.587.000	NGG Finance Plc*	5,63 %	18.06.2073	123.874.260	6,63
3.500.000	Orsted AS*	2,50 %	29.12.2049	2.689.706	0,14
23.597.000	SSE Plc*	3,74 %	29.12.2049	25.672.138	1,37
32.500.000	Vattenfall AB*	6,88 %	17.08.2083	37.800.197	2,02
	Britisches Pfund insgesamt			**430.873.063**	**23,05**
	US-Dollar				
48.750.000	British Telecommunications Plc*	4,25 %	23.11.2081	40.820.536	2,18
66.590.000	Enbridge Inc**	5,50 %	15.07.2077	55.206.067	2,95
20.000.000	Enbridge Inc**	8,25 %	15.01.2084	18.726.782	1,00
19.500.000	PPL Capital Funding Inc*	8,27 %	30.03.2067	16.480.276	0,88
12.455.000	Rogers Communications Inc**	5,25 %	15.03.2082	10.848.784	0,58

Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Netto-vermögens
	Unternehmensanleihen 93,25 % (31. Dezember 2022: 91,91 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
2.000.000	Vodafone Group Plc**	3,25 %	04.06.2081	1.668.853	0,09
81.487.000	Vodafone Group Plc*	6,25 %	03.10.2078	73.578.412	3,94
	US-Dollar insgesamt			**217.329.710**	**11,62**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**1.743.583.625**	**93,25**

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Investmentfonds 0,59 % (31. Dezember 2022: 0,58 %)		
	US-Dollar		
1.300.000	Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund	10.956.412	0,59
	Investmentfonds insgesamt µ	**10.956.412**	**0,59**
	Anlagen insgesamt	**1.754.540.037**	**93,84**

Devisenterminkontrakte 0,64 % (31. Dezember 2022: 2,05 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettover-mögens
6.407.281 €	5.526.226 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	33.258	0,00
11.192.060 €	12.066.657 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	275.347	0,02
1.895.251 €	1.627.710 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	17.829	0,00
291.260.860 €	310.288.338 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	10.542.800	0,56
22.477.139 £	25.906.424 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	19.004	0,00
14.496.290 US$	13.100.000 €	18.01.2024	UBS AG	1	14.803	0,00
Abgesicherte Klassen AUD						
191.185 AUD	115.925 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	2.159	0,00
5.145.727 AUD	3.107.269 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	70.957	0,00
Abgesicherte Klassen CHF						
144.858 CHF	152.593 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	3.371	0,00
34.799 CHF	36.940 €	18.01.2024	UBS AG	1	527	0,00
11.164.379 CHF	11.738.048 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	6	282.274	0,02
Abgesicherte Klassen GBP						
122.047 €	105.157 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	27	758	0,00
16.094.136 £	18.548.632 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	14.556	0,00
417.717 £	479.601 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	16	2.200	0,00
Abgesicherte Klassen SGD						
3.738 €	5.434 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	9	0,00
21.255 SGD	14.540 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	49	0,00
Abgesicherte Klassen USD						
1.488.862 €	1.631.501 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	12.842	0,00
16.115.313 €	17.165.198 US$	18.01.2024	UBS AG	2	585.947	0,03
10.525.674 €	11.388.561 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	60	222.436	0,01
10.533 US$	9.479 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	50	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**12.101.176**	**0,64**

Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**1.766.641.213**	**94,48**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,41 %) (31. Dezember 2022: (1,14 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettover-mögens
492.808.467 €	427.618.156 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(411.950)	(0,02)
2.127.209 €	1.850.257 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(6.902)	(0,00)
4.916.255 US$	4.500.000 €	18.01.2024	UBS AG	1	(52.261)	(0,00)
4.368.416 US$	4.064.684 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(112.575)	(0,01)
Abgesicherte Klassen AUD						
155.164 €	253.240 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(1.247)	(0,00)
Abgesicherte Klassen CHF						
52.458 €	49.263 CHF	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(582)	(0,00)
5.170.860 €	4.918.726 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	12	(124.972)	(0,01)
Abgesicherte Klassen GBP						
4.512.164 €	3.915.408 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(3.919)	(0,00)
586.121 €	511.172 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	55	(3.473)	(0,00)
209.165 £	243.689 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(2.435)	(0,00)
115.911 £	134.851 €	18.01.2024	UBS AG	1	(1.157)	(0,00)
150.292 £	174.953 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	(1.604)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SGD						
7.303 €	10.642 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
1.656.782 SGD	1.148.107 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(10.976)	(0,00)
90.089 SGD	62.329 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	8	(497)	(0,00)
Abgesicherte Klassen USD						
309.606 €	344.111 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(1.712)	(0,00)
10.954.404 US$	10.140.044 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	9	(229.588)	(0,01)
196.305.169 US$	184.298.441 €	18.01.2024	UBS AG	2	(6.701.029)	(0,36)
2.234.565 US$	2.086.860 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	26	(65.250)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞]					**(7.732.130)**	**(0,41)**

	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(7.732.130)**	**(0,41)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**1.758.909.083**	**94,07**
Sonstiges Nettovermögen	**110.907.380**	**5,93**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**1.869.816.463**	**100,00**

Corporate Hybrid Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

	Portfolioanalyse	EUR	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	1.657.133.139	87,97
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	86.450.486	4,59
µ	Investmentfonds	10.956.412	0,58
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	4.369.046	0,23
Anlagen insgesamt		**1.758.909.083**	**93,37**

Developed Market FMP - 2027 - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Unternehmensanleihen 98,78 %				
	US-Dollar				
3.650.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	2,45 %	29.10.2026	3.381.224	2,46
3.600.000	Air Lease Corp*	3,63 %	01.04.2027	3.407.834	2,48
560.000	Ally Financial Inc*	5,75 %	20.11.2025	556.939	0,41
1.295.833	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50 %	20.04.2026	1.287.461	0,94
2.800.000	American Tower Corp*	3,65 %	15.03.2027	2.694.987	1,96
1.285.000	Amsted Industries Inc**	5,63 %	01.07.2027	1.281.696	0,93
915.000	APX Group Inc**	6,75 %	15.02.2027	914.003	0,67
1.200.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	7,00 %	01.11.2026	1.210.230	0,88
1.000.000	AT&T Inc**	3,80 %	15.02.2027	976.399	0,71
2.795.000	Bank of America Corp*	4,25 %	22.10.2026	2.745.735	2,00
1.750.000	BAT Capital Corp*	4,70 %	02.04.2027	1.733.286	1,26
355.000	Bath & Body Works Inc*	6,69 %	15.01.2027	363.134	0,26
440.000	Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**	7,63 %	15.12.2025	446.183	0,32
3.000.000	BNP Paribas SA**	1,68 %	30.06.2027	2.749.236	2,00
2.100.000	Boeing Co*	5,04 %	01.05.2027	2.119.452	1,54
3.500.000	BPCE SA**	4,88 %	01.04.2026	3.431.618	2,50
1.475.000	Broadcom Inc**	3,46 %	15.09.2026	1.426.946	1,04
580.000	Buckeye Partners LP**	3,95 %	01.12.2026	548.590	0,40
3.600.000	Capital One Financial Corp*	3,65 %	11.05.2027	3.434.116	2,50
920.000	Carnival Corp**	7,63 %	01.03.2026	937.209	0,68
1.700.000	Carrier Global Corp**	2,49 %	15.02.2027	1.599.245	1,16
1.225.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,13 %	01.05.2027	1.182.914	0,86
700.000	CNH Industrial Capital LLC*	1,45 %	15.07.2026	642.318	0,47
910.000	Corebridge Financial Inc**	3,65 %	05.04.2027	875.905	0,64
705.000	Coty Inc**	6,50 %	15.04.2026	704.828	0,51
2.215.000	Crown Castle Inc*	2,90 %	15.03.2027	2.072.882	1,51
630.000	CSC Holdings LLC**	5,50 %	15.04.2027	582.729	0,42
2.125.000	Dell International LLC/EMC Corp**	4,90 %	01.10.2026	2.129.182	1,55
2.650.000	Energy Transfer LP*	4,20 %	15.04.2027	2.576.641	1,87
835.000	Energy Transfer LP**	5,63 %	01.05.2027	832.704	0,61
1.255.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2027	1.291.763	0,94
3.175.000	Ford Motor Credit Co LLC*	6,95 %	10.06.2026	3.258.984	2,37
3.250.000	General Motors Financial Co Inc*	5,00 %	09.04.2027	3.244.667	2,36
560.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00 %	15.01.2027	569.691	0,41
3.000.000	Global Payments Inc*	2,15 %	15.01.2027	2.763.490	2,01
2.650.000	HCA Inc*	4,50 %	15.02.2027	2.620.351	1,91
1.725.000	Hess Corp*	4,30 %	01.04.2027	1.708.050	1,24

Developed Market FMP - 2027 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 98,78 % (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.850.000	HP Inc*	3,00 %	17.06.2027	1.750.415	1,27
3.600.000	HSBC Holdings Plc*	1,59 %	24.05.2027	3.303.441	2,40
3.000.000	Imperial Brands Finance Plc*	6,13 %	27.07.2027	3.082.517	2,24
860.000	Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc**	5,00 %	01.02.2026	859.247	0,63
3.250.000	Lloyds Banking Group Plc*	3,75 %	11.01.2027	3.121.927	2,27
1.070.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,88 %	15.08.2026	1.089.789	0,79
3.300.000	Micron Technology Inc**	4,19 %	15.02.2027	3.238.419	2,36
3.400.000	Morgan Stanley*	3,95 %	23.04.2027	3.302.459	2,40
2.075.000	MPLX LP*	4,13 %	01.03.2027	2.032.764	1,48
3.300.000	Nationwide Building Society*	4,00 %	14.09.2026	3.170.006	2,31
2.675.000	NatWest Group Plc*	1,64 %	14.06.2027	2.444.545	1,78
1.465.000	New Fortress Energy Inc**	6,75 %	15.09.2025	1.453.818	1,06
1.100.000	NiSource Inc*	3,49 %	15.05.2027	1.059.911	0,77
1.010.000	NOVA Chemicals Corp**	5,25 %	01.06.2027	948.126	0,69
925.000	NRG Energy Inc*	6,63 %	15.01.2027	927.637	0,67
725.000	OneMain Finance Corp**	7,13 %	15.03.2026	739.111	0,54
1.400.000	Oracle Corp*	2,80 %	01.04.2027	1.321.236	0,96
3.400.000	Paramount Global**	2,90 %	15.01.2027	3.148.529	2,29
1.675.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	7,50 %	01.06.2025	1.685.535	1,23
1.635.000	Penn Entertainment Inc**	5,63 %	15.01.2027	1.587.890	1,16
2.650.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp**	4,50 %	15.12.2026	2.617.387	1,90
2.970.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75 %	15.04.2026	2.984.615	2,17
2.775.000	Rogers Communications Inc**	3,20 %	15.03.2027	2.649.784	1,93
1.035.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	31.08.2026	1.025.450	0,75
3.800.000	Santander UK Group Holdings Plc*	1,67 %	14.06.2027	3.457.077	2,52
800.000	Sempra*	3,25 %	15.06.2027	758.738	0,55
3.000.000	Stellantis Finance US Inc**	1,71 %	29.01.2027	2.725.842	1,98
955.000	TK Elevator US Newco Inc**	5,25 %	15.07.2027	939.107	0,68
1.250.000	T-Mobile USA Inc**	3,75 %	15.04.2027	1.212.785	0,88
960.000	TransDigm Inc*	7,50 %	15.03.2027	965.463	0,70
3.200.000	UBS Group AG*	4,55 %	17.04.2026	3.159.572	2,30
3.500.000	Viatris Inc**	2,30 %	22.06.2027	3.175.885	2,31
1.640.000	Vistra Operations Co LLC**	5,63 %	15.02.2027	1.618.665	1,18
3.080.000	Warnermedia Holdings Inc**	3,76 %	15.03.2027	2.952.304	2,15
1.000.000	Williams Cos Inc*	3,75 %	15.06.2027	964.568	0,70
	Unternehmensanleihen insgesamt			**135.777.186**	**98,78**
	Anlagen insgesamt			**135.777.186**	**98,78**

Developed Market FMP - 2027 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,03 %

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
8.274 €	9.001 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	145	0,00
492.259 €	524.041 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	20.072	0,02
504.986 €	538.555 US$	18.01.2024	UBS AG	5	19.624	0,01
5.676 €	6.246 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	28	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**39.869**	**0,03**

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**135.817.055**	**98,81**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,00 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
7.797 €	8.639 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(21)	(0,00)
8.150 US$	7.710 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(372)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(393)**	**(0,00)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(393)**	**(0,00)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**135.816.662**	**98,81**
Sonstiges Nettovermögen	**1.641.157**	**1,19**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**137.457.819**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	74.716.057	54,22
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	61.061.129	44,31
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	39.476	0,03
Anlagen insgesamt		**135.816.662**	**98,56**

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Unternehmensanleihen 27,64 % (31. Dezember 2022: 31,50 %)				
	Euro				
700.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	2,75 %	22.01.2033	595.501	0,02
6.921.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*	7,13 %	19.07.2026	3.629.445	0,14
20.129.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	1,88 %	05.11.2031	18.126.824	0,68
	Euro insgesamt			**22.351.770**	**0,84**
	US-Dollar				
2.072.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	3,65 %	02.11.2029	1.970.990	0,07
21.827.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60 %	02.11.2047	20.087.999	0,76
3.684.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC*	4,70 %	24.04.2033	3.739.168	0,14
4.527.000	Abu Dhabi Ports Co PJSC*	2,50 %	06.05.2031	3.862.233	0,15
6.565.000	Adani Electricity Mumbai Ltd**	3,95 %	12.02.2030	5.383.428	0,20
5.990.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ*	6,25 %	10.12.2024	5.926.486	0,22
5.620.000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA**	5,13 %	11.08.2061	4.286.514	0,16
3.195.000	African Export-Import Bank*	3,80 %	17.05.2031	2.717.242	0,10
3.973.057	Alfa Desarrollo SpA**	4,55 %	27.09.2051	3.105.655	0,12
2.556.000	Alibaba Group Holding Ltd*	3,25 %	09.02.2061	1.609.471	0,06
1.528.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc*	3,75 %	01.10.2030	1.329.617	0,05
3.283.000	Banco Nacional de Panama*	2,50 %	11.08.2030	2.439.876	0,09
3.143.000	Bank Leumi Le-Israel BM**	3,28 %	29.01.2031	2.848.972	0,11
16.866.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	4,70 %	22.10.2031	14.413.515	0,54
12.145.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	5,00 %	27.07.2027	11.338.876	0,43
5.905.000	Bidvest Group UK Plc*	3,63 %	23.09.2026	5.491.650	0,21
9.867.939	Bioceanico Sovereign Certificate Ltd*	0,00 %	05.06.2034	7.070.462	0,27
6.668.500	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais**	5,33 %	15.02.2028	6.570.673	0,25
3.254.000	Cemex SAB de CV**	5,13 %	29.12.2049	3.088.636	0,12
7.156.000	Cemex SAB de CV**	9,13 %	29.12.2049	7.629.937	0,29
4.626.000	Cencosud SA*	4,38 %	17.07.2027	4.466.244	0,17
227.000	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd*	4,00 %	29.12.2049	225.102	0,01
9.282.000	Comision Federal de Electricidad*	3,35 %	09.02.2031	7.762.482	0,29
8.419.000	Comision Federal de Electricidad*	4,69 %	15.05.2029	7.932.194	0,30
6.388.000	Comision Federal de Electricidad*	6,26 %	15.02.2052	5.612.023	0,21
2.193.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,00 %	30.09.2029	1.958.357	0,07
6.749.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,15 %	14.01.2030	6.034.908	0,23
5.844.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,70 %	30.01.2050	4.229.787	0,16
1.373.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	4,38 %	05.02.2049	1.116.085	0,04
150.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	6,15 %	24.10.2036	154.031	0,01
3.594.000	Corp. Nacional del Cobre de Chile*	5,13 %	02.02.2033	3.488.904	0,13
4.505.000	Corp. Nacional del Cobre de Chile*	5,95 %	08.01.2034	4.578.747	0,17
2.616.000	CSN Inova Ventures**	6,75 %	28.01.2028	2.557.953	0,10

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 27,64 % (31. Dezember 2022: 31,50 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
10.306.000	CSN Resources SA**	4,63 %	10.06.2031	8.437.047	0,32
4.989.000	CSN Resources SA**	8,88 %	05.12.2030	5.203.627	0,20
2.934.000	CT Trust**	5,13 %	03.02.2032	2.567.417	0,10
3.314.000	DP World Crescent Ltd*	3,88 %	18.07.2029	3.145.801	0,12
7.200.000	DP World Ltd*	6,85 %	02.07.2037	7.965.043	0,30
5.914.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,13 %	30.06.2028	5.124.481	0,19
6.636.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,88 %	23.05.2024	6.566.123	0,25
5.626.000	Ecopetrol SA*	5,88 %	02.11.2051	4.263.017	0,16
5.120.000	Ecopetrol SA**	6,88 %	29.04.2030	5.079.994	0,19
5.395.000	Ecopetrol SA*	8,88 %	13.01.2033	5.867.904	0,22
5.783.000	Empresa de Transmision Electrica SA*	5,13 %	02.05.2049	4.203.345	0,16
5.719.000	Empresa Nacional del Petroleo**	3,45 %	16.09.2031	4.826.303	0,18
3.031.000	Empresa Nacional del Petroleo**	4,50 %	14.09.2047	2.292.042	0,09
1.340.000	Empresa Nacional del Petroleo*	4,50 %	14.09.2047	1.013.390	0,04
5.830.000	Empresa Nacional del Petroleo*	5,25 %	06.11.2029	5.656.609	0,21
1.814.000	Empresa Nacional del Petroleo*	6,15 %	10.05.2033	1.821.994	0,07
4.395.003	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd**	2,16 %	31.03.2034	3.824.581	0,14
8.304.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63 %	31.03.2036	6.868.124	0,26
9.747.372	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,94 %	30.09.2040	8.037.918	0,30
5.445.000	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	4.922.280	0,19
9.182.000	Grupo Aval Ltd*	4,38 %	04.02.2030	7.806.527	0,29
1.685.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00 %	18.09.2027	1.506.323	0,06
2.633.000	Kallpa Generacion SA*	4,13 %	16.08.2027	2.518.752	0,10
7.140.000	KazMunayGas National Co JSC*	3,50 %	14.04.2033	5.951.733	0,22
31.427.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,38 %	24.04.2030	31.233.034	1,18
15.847.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,75 %	19.04.2047	13.930.654	0,53
12.734.000	KazMunayGas National Co JSC*	6,38 %	24.10.2048	11.988.237	0,45
2.026.000	Khazanah Capital Ltd*	4,88 %	01.06.2033	2.037.066	0,08
6.221.887	Leviathan Bond Ltd*	6,75 %	30.06.2030	5.696.492	0,22
17.190.582	MC Brazil Downstream Trading Sarl**	7,25 %	30.06.2031	13.493.576	0,51
2.850.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	4,38 %	22.11.2033	2.779.710	0,11
991.000	MDGH GMTN RSC Ltd**	5,08 %	22.05.2053	978.271	0,04
2.196.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	5,50 %	28.04.2033	2.329.473	0,09
2.421.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	5,88 %	01.05.2034	2.646.858	0,10
4.652.000	Medco Bell Pte Ltd**	6,38 %	30.01.2027	4.432.481	0,17
2.334.000	Meituan*	3,05 %	28.10.2030	1.971.714	0,07
3.734.000	Mexico City Airport Trust*	5,50 %	31.07.2047	3.227.427	0,12
4.496.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*	4,50 %	29.12.2049	4.323.601	0,16
11.954.000	Nexa Resources SA**	5,38 %	04.05.2027	11.679.033	0,44

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 27,64 % (31. Dezember 2022: 31,50 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
3.167.000	NWD MTN Ltd**	4,13 %	18.07.2029	2.416.547	0,09
14.318.000	Oil & Gas Holding Co BSCC**	7,50 %	25.10.2027	15.153.169	0,57
4.043.000	Ooredoo International Finance Ltd*	2,63 %	08.04.2031	3.532.357	0,13
4.474.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III*	4,70 %	06.06.2032	4.521.760	0,17
2.675.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	4,38 %	05.02.2050	2.217.468	0,08
8.423.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	5,25 %	15.05.2047	7.909.660	0,30
15.682.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	6,15 %	21.05.2048	16.105.492	0,61
10.489.000	Petrobras Global Finance BV*	6,50 %	03.07.2033	10.659.362	0,40
11.455.000	Petroleos de Venezuela SA*	5,38 %	12.04.2027	1.277.233	0,05
730.000	Petroleos de Venezuela SA*	5,50 %	12.04.2037	82.125	0,00
38.698.964	Petroleos de Venezuela SA*	6,00 %	16.05.2024	4.449.525	0,17
26.169.079	Petroleos de Venezuela SA**	6,00 %	15.11.2026	3.042.155	0,11
5.618.000	Petroleos del Peru SA*	4,75 %	19.06.2032	4.037.140	0,15
25.851.000	Petroleos del Peru SA*	5,63 %	19.06.2047	15.949.421	0,60
6.035.000	Petroleos Mexicanos**	6,95 %	28.01.2060	3.982.291	0,15
59.060.000	Petroleos Mexicanos**	7,69 %	23.01.2050	42.076.376	1,59
3.706.000	Power Finance Corp Ltd*	3,95 %	23.04.2030	3.431.441	0,13
2.898.000	Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd**	3,08 %	29.12.2049	2.727.453	0,10
4.596.000	QatarEnergy*	3,30 %	12.07.2051	3.366.561	0,13
3.147.000	QNB Finance Ltd*	2,75 %	12.02.2027	2.940.085	0,11
12.097.000	Reliance Industries Ltd*	2,88 %	12.01.2032	10.372.937	0,39
8.411.000	Reliance Industries Ltd*	3,63 %	12.01.2052	6.181.044	0,23
4.850.000	Sasol Financing USA LLC*	5,88 %	27.03.2024	4.824.684	0,18
10.610.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50 %	27.09.2028	10.119.108	0,38
5.969.000	Sasol Financing USA LLC*	8,75 %	03.05.2029	6.096.273	0,23
9.894.000	Saudi Arabian Oil Co*	4,25 %	16.04.2039	8.871.811	0,33
1.782.000	Saudi Electricity Sukuk Programme Co*	5,68 %	11.04.2053	1.833.190	0,07
50.492.000	Southern Gas Corridor CJSC*	6,88 %	24.03.2026	51.365.512	1,94
27.571.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic*	6,95 %	18.03.2030	29.070.173	1,10
4.484.000	Suzano Austria GmbH**	7,00 %	16.03.2047	4.747.388	0,18
1.876.000	Telecomunicaciones Digitales SA**	4,50 %	30.01.2030	1.618.802	0,06
6.803.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24 %	03.06.2050	4.542.407	0,17
778.000	Tencent Holdings Ltd**	3,29 %	03.06.2060	493.395	0,02
5.985.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	3,25 %	15.08.2030	4.946.124	0,19
1.900.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	2,63 %	15.08.2025	1.792.257	0,07
4.752.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	6,50 %	08.01.2026	4.720.851	0,18
6.352.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	9,00 %	12.10.2028	6.676.841	0,25
42.750	Ukreximbank Via Biz Finance Plc**	9,75 %	22.01.2025	41.493	0,00
11.580.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95 %	11.03.2025	8.621.773	0,33
450.000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc*	6,80 %	22.11.2025	31.091	0,00
	US-Dollar insgesamt			**710.090.994**	**26,80**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**732.442.764**	**27,64**

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 67,71 % (31. Dezember 2022: 60,52 %)				
	Euro				
7.246.146	Argentine Republic Government International Bond*	0,13 %	09.07.2030	2.898.797	0,11
1.008.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	0,50 %	08.07.2031	871.087	0,03
10.976.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	5,13 %	22.02.2033	13.211.588	0,50
1.825.000	Benin Government International Bond*	4,88 %	19.01.2032	1.655.286	0,06
9.957.000	Benin Government International Bond*	4,95 %	22.01.2035	8.696.084	0,33
1.367.000	Benin Government International Bond*	6,88 %	19.01.2052	1.193.096	0,04
2.600.000	Chile Government International Bond*	0,83 %	02.07.2031	2.382.011	0,09
2.555.856	Chile Government International Bond*	4,13 %	05.07.2034	2.890.098	0,11
1.757.000	Egypt Government International Bond*	4,75 %	11.04.2025	1.772.940	0,07
3.170.000	Egypt Government International Bond*	4,75 %	16.04.2026	2.852.290	0,11
10.344.000	Egypt Government International Bond*	5,63 %	16.04.2030	7.328.340	0,28
26.313.000	Egypt Government International Bond*	6,38 %	11.04.2031	18.736.017	0,71
1.600.000	Indonesia Government International Bond*	1,00 %	28.07.2029	1.543.362	0,06
13.889.000	Indonesia Government International Bond*	1,10 %	12.03.2033	12.177.345	0,46
32.691.000	Indonesia Government International Bond*	1,40 %	30.10.2031	30.707.032	1,16
4.420.000	Ivory Coast Government International Bond*	4,88 %	30.01.2032	4.127.686	0,15
19.259.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,25 %	22.03.2030	19.149.370	0,72
6.400.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,88 %	17.10.2031	6.357.835	0,24
25.722.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,63 %	22.03.2048	22.731.045	0,86
35.471.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,88 %	17.10.2040	32.901.998	1,24
1.018.000	Kazakhstan Government International Bond*	2,38 %	09.11.2028	1.085.293	0,04
3.764.000	Magyar Export-Import Bank Zrt*	6,00 %	16.05.2029	4.422.312	0,17
800.000	Mexico Government International Bond*	2,25 %	12.08.2036	696.766	0,03
31.575.000	Peruvian Government International Bond*	1,25 %	11.03.2033	27.463.839	1,04
17.290.000	Peruvian Government International Bond*	1,95 %	17.11.2036	14.448.790	0,54
10.662.000	Peruvian Government International Bond*	3,75 %	01.03.2030	11.725.014	0,44
9.245.000	Philippine Government International Bond*	1,75 %	28.04.2041	7.164.725	0,27
2.675.372	Provincia de Buenos Aires*	4,50 %	01.09.2037	1.026.053	0,04
10.227.000	Republic of Cameroon International Bond*	5,95 %	07.07.2032	8.370.136	0,32
3.314.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	28.01.2032	2.842.740	0,11
9.494.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	14.04.2033	7.878.927	0,30
817.000	Romanian Government International Bond*	2,12 %	16.07.2031	722.251	0,03
5.745.000	Romanian Government International Bond*	2,63 %	02.12.2040	4.282.314	0,16
3.517.000	Romanian Government International Bond*	2,88 %	13.04.2042	2.637.322	0,10
28.187.000	Romanian Government International Bond*	3,38 %	28.01.2050	21.328.687	0,80
955.000	Romanian Government International Bond*	3,62 %	26.05.2030	972.404	0,04
36.654.000	Romanian Government International Bond*	3,75 %	07.02.2034	35.012.132	1,32
26.936.000	Romanian Government International Bond*	3,88 %	29.10.2035	25.450.872	0,96
4.006.000	Romanian Government International Bond*	6,38 %	18.09.2033	4.688.600	0,18
6.507.000	Senegal Government International Bond*	4,75 %	13.03.2028	6.656.911	0,25

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 67,71 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
33.379.000	Serbia International Bond*	1,50 %	26.06.2029	31.229.093	1,18
15.589.000	Serbia International Bond*	1,65 %	03.03.2033	12.773.430	0,48
16.343.000	Serbia International Bond*	2,05 %	23.09.2036	12.608.331	0,47
833.000	Serbia International Bond*	3,13 %	15.05.2027	882.467	0,03
6.760.000	Tunisian Republic*	5,63 %	17.02.2024	7.229.297	0,27
9.831.000	Tunisian Republic*	6,38 %	15.07.2026	7.612.035	0,29
8.226.000	Ukraine Government International Bond**	6,75 %	20.06.2028	2.244.434	0,08
	Euro insgesamt			**457.638.482**	**17,27**
	US-Dollar				
5.924.000	Abu Dhabi Government International Bond*	2,70 %	02.09.2070	3.765.117	0,14
4.643.000	Angolan Government International Bond*	8,25 %	09.05.2028	4.291.688	0,16
24.627.000	Angolan Government International Bond*	8,75 %	14.04.2032	21.726.481	0,82
4.285.000	Angolan Government International Bond*	9,13 %	26.11.2049	3.508.344	0,13
38.843.000	Angolan Government International Bond*	9,38 %	08.05.2048	32.425.282	1,22
30.687.000	Arab Republic of Egypt*	8,88 %	29.05.2050	19.642.380	0,74
83.941.215	Argentine Republic Government International Bond*	0,75 %	09.07.2030	33.870.844	1,28
9.830.000	Argentine Republic Government International Bond*	1,00 %	09.07.2029	3.951.660	0,15
148.282.658	Argentine Republic Government International Bond*	3,63 %	09.07.2035	51.241.323	1,93
12.800.000	Bahamas Government International Bond*	6,00 %	21.11.2028	11.392.000	0,43
4.706.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	5,38 %	22.05.2033	4.781.432	0,18
1.807.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	6,25 %	31.10.2028	1.910.687	0,07
2.674.000	Bermuda Government International Bond*	2,38 %	20.08.2030	2.302.020	0,09
10.298.000	Bermuda Government International Bond*	4,75 %	15.02.2029	10.260.412	0,39
11.958.000	Bermuda Government International Bond*	5,00 %	15.07.2032	11.892.231	0,45
10.178.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	07.01.2041	9.433.542	0,36
12.816.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	21.02.2047	11.298.805	0,43
18.673.000	Brazilian Government International Bond*	6,00 %	20.10.2033	18.713.992	0,71
4.319.000	Brazilian Government International Bond**	6,25 %	18.03.2031	4.487.878	0,17
6.492.000	Chile Government International Bond*	3,25 %	21.09.2071	4.374.841	0,16
3.112.000	Chile Government International Bond*	4,95 %	05.01.2036	3.082.979	0,12
19.946.000	Colombia Government International Bond*	3,00 %	30.01.2030	16.882.693	0,64
24.593.000	Colombia Government International Bond*	5,00 %	15.06.2045	19.166.923	0,72
25.758.000	Colombia Government International Bond*	5,20 %	15.05.2049	20.206.299	0,76
7.245.000	Colombia Government International Bond*	6,13 %	18.01.2041	6.609.177	0,25
30.377.000	Colombia Government International Bond*	7,50 %	02.02.2034	32.139.688	1,21
7.603.000	Colombia Government International Bond*	8,00 %	20.04.2033	8.306.469	0,31
4.876.000	Colombia Government International Bond**	8,00 %	14.11.2035	5.343.997	0,20
3.615.000	Colombia Government International Bond*	8,75 %	14.11.2053	4.165.399	0,16

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 67,71 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.043.000	Corp Financiera de Desarrollo SA*	2,40 %	28.09.2027	930.283	0,03
6.603.000	Costa Rica Government International Bond*	6,55 %	03.04.2034	6.854.739	0,26
2.809.000	Costa Rica Government International Bond*	7,00 %	04.04.2044	2.943.832	0,11
1.471.000	Costa Rica Government International Bond*	7,16 %	12.03.2045	1.565.144	0,06
14.099.000	Costa Rica Government International Bond*	7,30 %	13.11.2054	15.332.663	0,58
40.427.000	Dominican Republic International Bond*	5,88 %	30.01.2060	35.069.154	1,32
6.800.000	Dominican Republic International Bond*	6,00 %	19.07.2028	6.828.560	0,26
4.757.000	Dominican Republic International Bond*	6,00 %	22.02.2033	4.703.484	0,18
25.430.000	Dominican Republic International Bond*	6,85 %	27.01.2045	25.430.000	0,96
633.000	Dominican Republic International Bond*	7,05 %	03.02.2031	666.233	0,02
6.407.540	Ecuador Government International Bond*	0,00 %	31.07.2030	1.843.612	0,07
19.683.223	Ecuador Government International Bond*	2,50 %	31.07.2040	6.298.631	0,24
92.184.478	Ecuador Government International Bond*	3,50 %	31.07.2035	33.217.453	1,25
10.350.055	Ecuador Government International Bond*	6,00 %	31.07.2030	4.836.673	0,18
8.531.000	Egypt Government International Bond*	7,90 %	21.02.2048	5.167.355	0,19
33.950.000	Egypt Government International Bond*	8,50 %	31.01.2047	21.233.756	0,80
5.113.000	Egypt Government International Bond*	8,70 %	01.03.2049	3.216.614	0,12
1.040.000	El Salvador Government International Bond*	7,63 %	01.02.2041	785.902	0,03
21.289.000	El Salvador Government International Bond*	7,65 %	15.06.2035	16.685.254	0,63
49.903.000	El Salvador Government International Bond*	9,50 %	15.07.2052	41.796.243	1,58
4.130.000	Emirate of Dubai Government International Bonds*	3,90 %	09.09.2050	3.118.910	0,12
9.580.000	Ethiopia International Bond*	6,63 %	11.12.2024	6.511.104	0,25
2.000.000	Ghana Government International Bond*	6,38 %	11.02.2027	898.100	0,03
13.833.000	Ghana Government International Bond*	7,63 %	16.05.2029	6.066.504	0,23
14.443.000	Ghana Government International Bond*	7,75 %	07.04.2029	6.349.576	0,24
12.017.000	Ghana Government International Bond*	7,88 %	11.02.2035	5.291.854	0,20
11.138.000	Ghana Government International Bond*	8,63 %	07.04.2034	4.891.609	0,18
5.375.000	Ghana Government International Bond*	8,75 %	11.03.2061	2.334.255	0,09
4.857.000	Ghana Government International Bond*	8,88 %	07.05.2042	2.097.738	0,08
7.783.000	Ghana Government International Bond*	8,95 %	26.03.2051	3.381.247	0,13
30.412.000	Ghana Government International Bond*	10,75 %	14.10.2030	19.254.628	0,73
5.237.000	Guatemala Government Bond*	3,70 %	07.10.2033	4.382.714	0,17
735.000	Guatemala Government Bond*	5,25 %	10.08.2029	722.321	0,03
5.190.000	Guatemala Government Bond*	5,38 %	24.04.2032	5.039.801	0,19
28.783.000	Guatemala Government Bond*	6,60 %	13.06.2036	29.718.449	1,12
2.898.000	Guatemala Government Bond*	7,05 %	04.10.2032	3.086.732	0,12
5.435.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS*	8,51 %	14.01.2029	5.771.970	0,22
3.260.000	Honduras Government International Bond*	5,63 %	24.06.2030	2.913.625	0,11
1.247.000	Honduras Government International Bond*	6,25 %	19.01.2027	1.200.238	0,05

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 67,71 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
6.360.000	Indonesia Government International Bond*	5,65 %	11.01.2053	7.018.968	0,26
400.000	Indonesia Government International Bond*	7,75 %	17.01.2038	514.114	0,02
3.637.000	Indonesia Government International Bond*	8,50 %	12.10.2035	4.846.303	0,18
829.125	Iraq International Bond*	5,80 %	15.01.2028	777.281	0,03
2.935.000	Istanbul Metropolitan Municipality*	10,50 %	06.12.2028	3.122.106	0,12
6.335.043	Ivory Coast Government International Bond*	5,75 %	31.12.2032	6.002.137	0,23
1.986.000	Jordan Government International Bond*	7,38 %	10.10.2047	1.770.730	0,07
45.992.000	Lebanon Government International Bond*	6,38 %	09.03.2020	2.817.010	0,11
21.038.000	Lebanon Government International Bond*	6,60 %	27.11.2026	1.294.089	0,05
58.532.000	Lebanon Government International Bond*	6,65 %	26.02.2030	3.667.685	0,14
6.112.000	Lebanon Government International Bond*	6,85 %	25.05.2029	377.984	0,01
83.325.000	Lebanon Government International Bond*	8,25 %	17.05.2034	5.189.064	0,20
46.520.000	Mexico Government International Bond*	5,75 %	12.10.2110	41.806.387	1,58
11.771.000	Mongolia Government International Bond*	3,50 %	07.07.2027	10.533.176	0,40
8.042.000	Mongolia Government International Bond*	5,13 %	07.04.2026	7.820.105	0,29
2.550.000	Mongolia Government International Bond*	7,88 %	05.06.2029	2.611.179	0,10
16.319.000	Mongolia Government International Bond*	8,65 %	19.01.2028	17.123.643	0,65
7.320.000	Morocco Government International Bond*	3,00 %	15.12.2032	6.039.761	0,23
6.001.000	Morocco Government International Bond*	6,50 %	08.09.2033	6.343.675	0,24
328.000	Nigeria Government International Bond*	7,63 %	21.11.2025	325.307	0,01
2.059.000	Nigeria Government International Bond*	7,70 %	23.02.2038	1.694.256	0,06
18.881.000	Nigeria Government International Bond*	7,88 %	16.02.2032	17.025.942	0,64
5.653.000	Nigeria Government International Bond*	8,25 %	28.09.2051	4.655.472	0,18
1.326.000	Nigeria Government International Bond*	8,38 %	24.03.2029	1.276.335	0,05
10.975.000	Nigeria Government International Bond*	8,75 %	21.01.2031	10.497.203	0,40
12.420.000	Nigeria Government International Bond*	9,25 %	21.01.2049	11.219.980	0,42
1.414.000	Oman Government International Bond*	6,50 %	08.03.2047	1.444.941	0,05
36.098.000	Oman Government International Bond*	6,75 %	17.01.2048	37.858.499	1,43
7.965.000	Oman Government International Bond*	7,00 %	25.01.2051	8.615.446	0,32
2.425.000	Panama Government International Bond*	3,87 %	23.07.2060	1.458.460	0,05
1.560.000	Panama Government International Bond*	4,30 %	29.04.2053	1.048.846	0,04
1.648.000	Panama Government International Bond*	4,50 %	16.04.2050	1.147.682	0,04
16.570.000	Panama Government International Bond*	4,50 %	01.04.2056	11.169.683	0,42
1.893.000	Panama Government International Bond*	4,50 %	19.01.2063	1.243.159	0,05
23.468.000	Panama Government International Bond*	6,40 %	14.02.2035	22.965.024	0,87
8.962.000	Panama Government International Bond*	6,70 %	26.01.2036	8.903.665	0,34
9.848.000	Panama Government International Bond*	6,85 %	28.03.2054	9.239.045	0,35
2.270.000	Panama Government International Bond*	6,88 %	31.01.2036	2.270.603	0,09
8.224.000	Papua New Guinea Government International Bond*	8,38 %	04.10.2028	7.866.256	0,30
3.375.000	Paraguay Government International Bond*	5,40 %	30.03.2050	3.009.657	0,11

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 67,71 % (31. Dezember 2022: 60,52 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
19.082.000	Paraguay Government International Bond*	5,60 %	13.03.2048	17.451.972	0,66
11.800.000	Provincia de Buenos Aires*	6,38 %	01.09.2037	4.548.495	0,17
432.007	Provincia de Cordoba*	6,88 %	10.12.2025	393.207	0,01
3.182.385	Provincia de Mendoza Argentina*	5,75 %	19.03.2029	2.728.895	0,10
27.657.000	Qatar Government International Bond*	4,82 %	14.03.2049	26.987.286	1,02
15.572.000	Republic of Armenia International Bond*	3,60 %	02.02.2031	12.771.812	0,48
4.860.000	Republic of Azerbaijan International Bond*	3,50 %	01.09.2032	4.228.278	0,16
800.000	Republic of Azerbaijan International Bond*	5,13 %	01.09.2029	787.465	0,03
14.739.000	Republic of Poland Government International Bond*	5,50 %	04.04.2053	15.406.618	0,58
2.482.000	Republic of Poland Government International Bond*	5,75 %	16.11.2032	2.685.251	0,10
20.508.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,75 %	30.09.2049	16.439.213	0,62
28.150.000	Republic of South Africa Government International Bond*	7,30 %	20.04.2052	26.739.854	1,01
1.472.000	Republic of Uzbekistan International Bond*	5,38 %	20.02.2029	1.397.721	0,05
11.443.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,75 %	18.04.2023	5.885.993	0,22
2.503.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,88 %	25.07.2024	1.325.339	0,05
6.070.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,13 %	03.06.2025	3.133.508	0,12
18.566.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,20 %	11.05.2027	9.427.863	0,36
15.440.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,75 %	18.04.2028	7.805.820	0,29
14.406.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	14.03.2024	7.335.903	0,28
15.107.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	03.11.2025	7.817.839	0,29
17.628.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,55 %	28.03.2030	8.899.866	0,34
40.882.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,85 %	14.03.2029	20.648.604	0,78
6.462.000	State Agency of Roads of Ukraine*	6,25 %	24.06.2030	1.665.581	0,06
15.411.000	Turkiye Government International Bond*	9,13 %	13.07.2030	17.047.186	0,64
6.563.000	Turkiye Government International Bond*	9,38 %	14.03.2029	7.273.904	0,27
4.502.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	9,38 %	31.01.2026	4.718.501	0,18
4.928.000	Ukraine Government International Bond*	6,88 %	21.05.2031	1.149.210	0,04
1.713.000	Ukraine Government International Bond*	7,25 %	15.03.2035	412.588	0,02
13.562.000	Ukraine Government International Bond*	7,38 %	25.09.2034	3.221.653	0,12
18.078.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2027	5.000.736	0,19
13.893.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2029	3.852.626	0,15
21.027.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.08.2041	9.485.427	0,36
20.660.000	Ukraine Government International Bond*	9,75 %	01.11.2030	5.991.400	0,23
10.314.000	Uzbekneftegaz JSC*	4,75 %	16.11.2028	8.616.584	0,32
32.118.500	Venezuela Government International Bond*	8,25 %	13.10.2024	5.049.820	0,19
14.430.000	Zambia Government International Bond*	5,38 %	20.09.2022	8.112.330	0,31
6.140.000	Zambia Government International Bond*	8,50 %	14.04.2024	3.840.140	0,14
35.408.000	Zambia Government International Bond*	8,97 %	30.07.2027	22.037.231	0,83
	US-Dollar insgesamt			**1.336.544.120**	**50,44**
	Staatsanleihen insgesamt			**1.794.182.602**	**67,71**

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Investmentfonds 0,66 % (31. Dezember 2022: 0,65 %)		
	US-Dollar		
150.000	Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	17.580.000	0,66
	Investmentfonds insgesamt [µ]	**17.580.000**	**0,66**
	Anlagen insgesamt	**2.544.205.366**	**96,01**

Devisenterminkontrakte 0,94 % (31. Dezember 2022: 0,50 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettovermögens
540.071.184 US$	488.041.561 €	02.02.2024	Citibank NA	1	261.317	0,01
Abgesicherte Klassen AUD						
24.943.593 AUD	16.477.116 US$	14.03.2024	UBS AG	4	580.222	0,02
633.467 AUD	420.539 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	13	12.649	0,00
Abgesicherte Klassen CHF						
2.798.935 CHF	3.252.651 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	3	97.421	0,00
153.876.209 CHF	177.741.159 US$	14.03.2024	UBS AG	2	6.434.750	0,24
4.508.829 CHF	5.231.287 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	9	165.373	0,01
18.709 US$	15.535 CHF	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	115	0,00
Abgesicherte Klassen EUR						
9.877.653 €	10.768.963 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	2	173.829	0,01
505.423.704 €	547.745.357 US$	14.03.2024	UBS AG	2	12.179.779	0,46
26.075.899 €	28.528.168 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	15	359.577	0,01
1.007.630 US$	904.653 €	14.03.2024	Westpac Banking Corp	4	5.425	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
1.596.317 £	2.030.520 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	5.199	0,00
83.600.674 £	105.431.067 US$	14.03.2024	UBS AG	2	1.181.504	0,05
3.272.877 £	4.129.662 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	17	44.106	0,00
87.068 US$	68.195 £	14.03.2024	Westpac Banking Corp	4	101	0,00
Abgesicherte Klassen HKD						
1.361.088 HKD	174.538 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	4	62	0,00
17.428 HKD	2.234 US$	14.03.2024	UBS AG	2	1	0,00
86.235 HKD	11.059 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	6	4	0,00
2.228 US$	17.364 HKD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	3	1	0,00
Abgesicherte Klassen JPY						
55.341.721 ¥	395.185 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	3	1.768	0,00
1.675.043.730 ¥	11.563.342 US$	14.03.2024	UBS AG	2	451.341	0,02
23.808.684 ¥	166.179 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	4.595	0,00
Abgesicherte Klassen SEK						
16.167.394 SEK	1.576.775 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	2	32.012	0,00
699.411.443 SEK	67.015.687 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	9	2.581.440	0,10
1.567 US$	15.548 SEK	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	20	0,00

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,94 % (31. Dezember 2022: 0,50 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen SGD						
23.183.806 SGD	17.371.032 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	6	262.563	0,01
442.286 SGD	332.455 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	11	3.950	0,00
29 US$	38 SGD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**24.839.124**	**0,94**

Futures-Kontrakte 0,74 % (31. Dezember 2022: 0,93 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
261	Euro-BOBL Future March 2024	279.664	0,01
801	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	3.285.352	0,12
684	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024	1.544.344	0,06
2.838	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	7.083.798	0,27
502	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024	5.043.531	0,19
271	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	2.331.625	0,09
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**19.568.314**	**0,74**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**2.588.612.804**	**97,69**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2022: (0,43 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
488.041.561 €	539.437.218 US$	03.01.2024	Citibank NA	1	(322.041)	(0,01)
23.589.737 US$	21.482.000 €	03.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(140.358)	(0,01)
510.507.792 US$	466.559.561 €	03.01.2024	HSBC Bank Plc	1	(4.877.290)	(0,18)
Abgesicherte Klassen AUD						
21.489 AUD	14.754 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	(58)	(0,00)
232.469 US$	348.524 AUD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	13	(5.865)	(0,00)
Abgesicherte Klassen CHF						
2.007.205 US$	1.720.656 CHF	14.03.2024	Westpac Banking Corp	24	(52.266)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
8.910.419 US$	8.149.411 €	14.03.2024	Westpac Banking Corp	19	(117.771)	(0,01)

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2022: (0,43 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen GBP						
802.294 £	1.025.677 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	4	(2.544)	(0,00)
605.158 US$	481.385 £	14.03.2024	Westpac Banking Corp	13	(8.734)	(0,00)
Abgesicherte Klassen HKD						
32.151 HKD	4.126 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	(1)	(0,00)
52.635 HKD	6.752 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	0	(0,00)
528 US$	4.118 HKD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	0	(0,00)
Abgesicherte Klassen JPY						
59.642 US$	8.554.284 ¥	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	(1.716)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SEK						
18.333.417 SEK	1.854.042 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	(29.718)	(0,00)
349.277 US$	3.637.463 SEK	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	(12.680)	(0,00)
3.323.704 US$	33.726.769 SEK	14.03.2024	Westpac Banking Corp	18	(32.384)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SGD						
680.217 SGD	517.434 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	(61)	(0,00)
82.934 US$	110.898 SGD	14.03.2024	UBS AG	1	(1.415)	(0,00)
3.094.522 US$	4.130.606 SGD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	19	(47.216)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞]					**(5.652.118)**	**(0,21)**

Futures-Kontrakte (0,39 %) (31. Dezember 2022: (0,05 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
(1.710)	Euro-Bund Future March 2024	(6.137.966)	(0,23)
(505)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024	(4.068.669)	(0,16)
(43)	Euro-Schatz Future March 2024	(16.150)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [±]		**(10.222.785)**	**(0,39)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(15.874.903)**	**(0,60)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**2.572.737.901**	**97,09**
Sonstiges Nettovermögen	**77.080.754**	**2,91**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**2.649.818.655**	**100,00**

Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

	Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	2.331.719.144	87,09
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	194.906.222	7,28
µ	Investmentfonds	17.580.000	0,66
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	9.345.529	0,35
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	19.187.006	0,72
Anlagen insgesamt		**2.572.737.901**	**96,10**

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Schatzwechsel 2,59 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
	Thailändischer Baht				
259.670.000	Bank of Thailand Bill	0,00 %	09.05.2024	7.548.955	0,59
	Thailändischer Baht insgesamt			**7.548.955**	**0,59**
	US-Dollar				
17.716.200	United States Treasury Bill	0,00 %	30.01.2024	17.643.335	1,37
8.308.000	United States Treasury Bill	0,00 %	16.05.2024	8.148.860	0,63
	US-Dollar insgesamt			**25.792.195**	**2,00**
	Schatzwechsel insgesamt **			**33.341.150**	**2,59**
	Unternehmensanleihen 3,25 % (31. Dezember 2022: 1,62 %)				
	Chinesischer Yuan Renminbi				
50.000.000	Central Huijin Investment Ltd**	2,74 %	24.05.2026	7.045.656	0,55
10.000.000	Central Huijin Investment Ltd**	2,80 %	27.10.2026	1.411.078	0,11
20.000.000	China Southern Power Grid Co Ltd**	3,66 %	25.02.2024	2.813.746	0,22
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt			**11.270.480**	**0,88**
	Kolumbianischer Peso				
4.004.000.000	Asian Development Bank*	11,20 %	31.01.2025	1.024.539	0,08
10.328.000.000	Asian Development Bank*	12,75 %	03.03.2025	2.701.436	0,21
10.000.000.000	Asian Development Bank*	13,00 %	07.03.2025	2.604.827	0,20
6.450.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	7,63 %	10.09.2024	1.603.741	0,12
49.079.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	8,38 %	08.11.2027	11.011.737	0,86
15.550.000.000	International Finance Corp*	0,00 %	16.08.2028	2.601.916	0,20
	Kolumbianischer Peso insgesamt			**21.548.196**	**1,67**
	Mexikanischer Peso				
102.700.000	Asian Infrastructure Investment Bank*	0,00 %	08.02.2038	1.671.388	0,13
72.618.300	Comision Federal de Electricidad*	7,35 %	25.11.2025	3.994.814	0,31
62.682.200	Comision Federal de Electricidad*	8,18 %	23.12.2027	3.340.722	0,26
	Mexikanischer Peso insgesamt			**9.006.924**	**0,70**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**41.825.600**	**3,25**
	Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %)				
	Chilenischer Peso				
6.439.587.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica*	1,90 %	01.09.2030	7.248.255	0,56
2.055.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	2,80 %	01.10.2033	1.927.140	0,15
5.865.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	4,50 %	01.03.2026	6.701.581	0,52
900.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	4,70 %	01.09.2030	1.009.825	0,08
2.335.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	5,00 %	01.03.2035	2.673.627	0,21

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)				
	Chilenischer Peso (Fortsetzung)				
445.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	5,10 %	15.07.2050	509.596	0,04
2.115.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	6,00 %	01.04.2033	2.585.962	0,20
3.570.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	7,00 %	01.05.2034	4.687.627	0,37
	Chilenischer Peso insgesamt			**27.343.613**	**2,13**
	Chinesischer Yuan Renminbi				
10.000.000	China Development Bank**	2,83 %	10.09.2026	1.421.187	0,11
20.000.000	China Development Bank**	2,98 %	22.04.2032	2.857.284	0,22
10.000.000	China Development Bank**	3,02 %	06.03.2033	1.436.354	0,11
30.000.000	China Development Bank**	3,30 %	03.03.2026	4.299.959	0,34
40.000.000	China Development Bank**	3,34 %	14.07.2025	5.704.354	0,44
10.000.000	China Development Bank**	3,48 %	08.01.2029	1.466.138	0,11
20.000.000	China Development Bank**	3,70 %	20.10.2030	2.990.060	0,23
40.000.000	China Development Bank**	4,04 %	06.07.2028	5.981.249	0,47
20.000.000	China Development Bank**	4,24 %	24.08.2027	2.982.709	0,23
20.000.000	China Government Bond**	2,18 %	15.08.2026	2.801.630	0,22
15.000.000	China Government Bond**	2,50 %	25.07.2027	2.115.479	0,17
8.000.000	China Government Bond**	2,52 %	25.08.2033	1.118.549	0,09
10.000.000	China Government Bond**	2,55 %	15.10.2028	1.414.269	0,11
9.000.000	China Government Bond**	2,60 %	15.09.2030	1.269.691	0,10
10.000.000	China Government Bond**	2,62 %	15.04.2028	1.418.011	0,11
20.000.000	China Government Bond**	2,62 %	25.09.2029	2.827.251	0,22
28.000.000	China Government Bond**	2,62 %	25.06.2030	3.953.322	0,31
20.000.000	China Government Bond**	2,64 %	15.01.2028	2.838.070	0,22
20.500.000	China Government Bond**	2,67 %	25.05.2033	2.898.456	0,23
13.000.000	China Government Bond**	2,69 %	15.08.2032	1.840.010	0,14
20.000.000	China Government Bond**	2,85 %	04.06.2027	2.853.877	0,22
22.000.000	China Government Bond**	2,88 %	25.02.2033	3.165.975	0,25
3.000.000	China Government Bond**	3,00 %	15.10.2053	436.585	0,03
10.000.000	China Government Bond**	3,01 %	13.05.2028	1.441.900	0,11
22.000.000	China Government Bond**	3,02 %	27.05.2031	3.192.027	0,25
30.000.000	China Government Bond**	3,13 %	21.11.2029	4.372.058	0,34
14.940.000	China Government Bond**	3,19 %	15.04.2053	2.233.443	0,17
10.000.000	China Government Bond**	3,25 %	22.11.2028	1.463.143	0,11
10.000.000	China Government Bond**	3,28 %	03.12.2027	1.457.632	0,11
5.000.000	China Government Bond**	3,29 %	23.05.2029	734.246	0,06
45.500.000	China Government Bond**	3,72 %	12.04.2051	7.397.434	0,58
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt			**82.382.352**	**6,41**

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)				
	Kolumbianischer Peso				
89.266.600.000	Colombian TES*	5,75 %	03.11.2027	20.427.166	1,59
123.861.700.000	Colombian TES*	6,00 %	28.04.2028	28.225.376	2,19
21.584.900.000	Colombian TES*	7,00 %	26.03.2031	4.809.779	0,37
25.028.700.000	Colombian TES*	7,00 %	30.06.2032	5.418.255	0,42
26.308.300.000	Colombian TES*	7,25 %	18.10.2034	5.595.098	0,44
9.231.900.000	Colombian TES*	7,50 %	26.08.2026	2.280.332	0,18
26.457.200.000	Colombian TES*	7,75 %	18.09.2030	6.229.120	0,48
22.429.000.000	Colombian TES*	9,25 %	28.05.2042	5.257.128	0,41
46.040.000.000	Colombian TES*	13,25 %	09.02.2033	14.115.371	1,10
10.400.100.000	Colombian TES Series G*	7,00 %	26.03.2031	2.317.462	0,18
1.303.000.000	Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter*	7,88 %	12.08.2024	324.371	0,03
	Kolumbianischer Peso insgesamt			**94.999.458**	**7,39**
	Tschechische Krone				
53.760.000	Czech Republic Government Bond*	0,05 %	29.11.2029	1.946.113	0,15
496.230.000	Czech Republic Government Bond*	0,95 %	15.05.2030	18.789.702	1,46
368.120.000	Czech Republic Government Bond*	1,00 %	26.06.2026	15.290.051	1,19
215.890.000	Czech Republic Government Bond*	1,20 %	13.03.2031	8.153.775	0,63
39.810.000	Czech Republic Government Bond*	1,50 %	24.04.2040	1.282.475	0,10
96.070.000	Czech Republic Government Bond*	1,75 %	23.06.2032	3.705.317	0,29
34.130.000	Czech Republic Government Bond*	1,95 %	30.07.2037	1.231.303	0,10
79.870.000	Czech Republic Government Bond*	2,00 %	13.10.2033	3.076.837	0,24
107.220.000	Czech Republic Government Bond*	2,40 %	17.09.2025	4.640.225	0,36
36.630.000	Czech Republic Government Bond*	2,50 %	25.08.2028	1.556.067	0,12
29.020.000	Czech Republic Government Bond*	2,75 %	23.07.2029	1.234.378	0,10
35.400.000	Czech Republic Government Bond*	4,20 %	04.12.2036	1.650.369	0,13
22.740.000	Czech Republic Government Bond*	5,00 %	30.09.2030	1.095.192	0,08
	Tschechische Krone insgesamt			**63.651.804**	**4,95**
	Peso Dominikanische Republik				
152.700.000	Dominican Republic International Bond*	9,75 %	05.06.2026	2.632.083	0,20
170.800.000	Dominican Republic International Bond*	11,25 %	15.09.2035	3.181.331	0,25
42.800.000	Dominican Republic International Bond*	13,63 %	03.02.2033	898.919	0,07
	Peso Dominikanische Republik insgesamt			**6.712.333**	**0,52**
	Ghanaischer Cedi				
7.520.645	Republic of Ghana Government Bonds*	8,35 %	16.02.2027	351.096	0,03
7.526.192	Republic of Ghana Government Bonds*	8,50 %	15.02.2028	303.909	0,02
7.029.623	Republic of Ghana Government Bonds*	8,65 %	13.02.2029	251.578	0,02
7.034.801	Republic of Ghana Government Bonds*	8,80 %	12.02.2030	228.773	0,02

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)				
	Ghanaischer Cedi (Fortsetzung)				
7.039.979	Republic of Ghana Government Bonds*	8,95 %	11.02.2031	211.825	0,02
7.045.156	Republic of Ghana Government Bonds*	9,10 %	10.02.2032	200.438	0,02
7.050.334	Republic of Ghana Government Bonds*	9,25 %	08.02.2033	192.372	0,01
	Ghanaischer Cedi insgesamt			**1.739.991**	**0,14**
	Ungarischer Forint				
2.765.060.000	Hungary Government Bond*	3,00 %	27.10.2027	7.285.452	0,57
712.080.000	Hungary Government Bond*	3,25 %	22.10.2031	1.750.084	0,13
2.891.560.000	Hungary Government Bond*	4,50 %	23.03.2028	7.967.633	0,62
4.784.820.000	Hungary Government Bond*	4,75 %	24.11.2032	12.758.605	0,99
1.891.190.000	Hungary Government Bond*	9,50 %	21.10.2026	5.924.773	0,46
	Ungarischer Forint insgesamt			**35.686.547**	**2,77**
	Indonesische Rupiah				
72.466.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,13 %	15.05.2028	4.649.284	0,36
237.648.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.08.2028	15.417.635	1,20
12.550.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.04.2032	803.979	0,06
11.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.07.2037	705.634	0,05
156.481.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63 %	15.05.2033	10.199.159	0,79
173.110.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63 %	15.02.2034	11.252.678	0,88
156.972.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,88 %	15.04.2029	10.359.202	0,81
64.288.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.05.2027	4.246.883	0,33
138.710.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.02.2033	9.344.162	0,73
159.990.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2038	10.890.429	0,85
79.350.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2042	5.363.710	0,42
73.178.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2043	4.942.185	0,38
97.706.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.08.2032	6.722.932	0,52
79.493.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.06.2035	5.470.933	0,43
20.280.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.05.2038	1.408.724	0,11
60.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.04.2040	4.162.574	0,32
39.425.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2029	2.761.363	0,21
73.362.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2036	5.357.619	0,42
58.565.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.09.2026	3.990.548	0,31
88.577.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.03.2034	6.434.302	0,50
98.837.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,75 %	15.05.2031	7.184.925	0,56
33.258.000.000	Indonesia Treasury Bond*	9,00 %	15.03.2029	2.390.308	0,19
	Indonesische Rupiah insgesamt			**134.059.168**	**10,43**
	Japanischer Yen				
11.253.000	Argentine Republic Government International Bond**	0,67 %	31.12.2038	15.017	0,00

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)				
	Japanischer Yen (Fortsetzung)				
7.424.445	Argentine Republic Government International Bond**	4,33 %	31.12.2033	9.367	0,00
	Japanischer Yen insgesamt			**24.384**	**0,00**
	Malaysischer Ringgit				
20.322.000	Malaysia Government Bond**	2,63 %	15.04.2031	4.086.389	0,32
27.226.000	Malaysia Government Bond**	3,50 %	31.05.2027	5.908.346	0,46
3.710.000	Malaysia Government Bond**	3,58 %	15.07.2032	792.423	0,06
31.882.000	Malaysia Government Bond**	3,73 %	15.06.2028	6.960.246	0,54
24.319.000	Malaysia Government Bond**	3,76 %	22.05.2040	5.065.762	0,39
31.512.000	Malaysia Government Bond**	3,83 %	05.07.2034	6.816.107	0,53
5.637.000	Malaysia Government Bond**	3,84 %	15.04.2033	1.227.457	0,10
80.535.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	16.11.2027	17.701.926	1,38
17.138.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	30.11.2026	3.770.405	0,29
31.229.000	Malaysia Government Bond**	4,07 %	15.06.2050	6.674.794	0,52
9.113.000	Malaysia Government Bond**	4,23 %	30.06.2031	2.035.670	0,16
16.765.000	Malaysia Government Bond**	4,25 %	31.05.2035	3.740.730	0,29
22.000.000	Malaysia Government Bond**	4,50 %	30.04.2029	4.979.348	0,39
4.800.000	Malaysia Government Bond**	4,50 %	15.04.2030	1.089.403	0,08
20.974.000	Malaysia Government Bond**	4,64 %	07.11.2033	4.902.771	0,38
67.418.000	Malaysia Government Bond**	4,70 %	15.10.2042	15.798.895	1,23
6.300.000	Malaysia Government Bond**	4,76 %	07.04.2037	1.478.936	0,12
46.510.000	Malaysia Government Bond**	4,89 %	08.06.2038	11.117.093	0,86
4.791.000	Malaysia Government Bond**	4,94 %	30.09.2043	1.139.540	0,09
26.306.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,07 %	30.09.2026	5.798.307	0,45
26.775.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,37 %	31.10.2028	6.002.130	0,47
	Malaysischer Ringgit insgesamt			**117.086.678**	**9,11**
	Mexikanischer Peso				
137.440.000	Mexican Bonos*	5,50 %	04.03.2027	7.280.923	0,57
261.449.400	Mexican Bonos*	7,50 %	03.06.2027	14.632.027	1,14
225.050.000	Mexican Bonos*	7,50 %	26.05.2033	12.132.788	0,94
410.643.600	Mexican Bonos*	7,75 %	29.05.2031	22.632.017	1,76
171.430.200	Mexican Bonos*	7,75 %	13.11.2042	8.912.407	0,69
90.673.600	Mexican Bonos*	8,00 %	07.11.2047	4.789.646	0,37
453.064.600	Mexican Bonos*	8,50 %	31.05.2029	26.196.923	2,04
201.443.000	Mexican Bonos*	8,50 %	18.11.2038	11.355.487	0,88
	Mexikanischer Peso insgesamt			**107.932.218**	**8,39**
	Peruanischer Sol				
24.441.000	Fondo MIVIVIENDA SA*	7,00 %	14.02.2024	6.569.352	0,51

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)				
	Peruanischer Sol (Fortsetzung)				
7.536.000	Peru Government Bond*	5,35 %	12.08.2040	1.745.018	0,14
22.336.000	Peru Government Bond*	5,40 %	12.08.2034	5.456.098	0,42
35.779.000	Peru Government Bond*	6,15 %	12.08.2032	9.442.084	0,73
23.856.000	Peru Government Bond*	7,30 %	12.08.2033	6.759.022	0,53
8.187.000	Peruvian Government International Bond*	5,40 %	12.08.2034	1.999.869	0,15
23.052.000	Peruvian Government International Bond**	6,90 %	12.08.2037	6.282.739	0,49
	Peruanischer Sol insgesamt			**38.254.182**	**2,97**
	Philippinischer Peso				
262.860.000	Philippine Government Bond*	6,75 %	15.09.2032	4.998.061	0,39
	Philippinischer Peso insgesamt			**4.998.061**	**0,39**
	Polnischer Zloty				
19.507.000	Republic of Poland Government Bond*	0,25 %	25.10.2026	4.362.147	0,34
31.927.000	Republic of Poland Government Bond**	1,25 %	25.10.2030	6.429.967	0,50
114.491.000	Republic of Poland Government Bond*	1,75 %	25.04.2032	22.659.391	1,76
86.365.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50 %	25.07.2026	20.690.509	1,61
53.964.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50 %	25.07.2027	12.689.477	0,98
62.747.000	Republic of Poland Government Bond*	2,75 %	25.10.2029	14.254.807	1,11
29.868.000	Republic of Poland Government Bond*	6,00 %	25.10.2033	8.060.973	0,63
122.011.000	Republic of Poland Government Bond*	7,50 %	25.07.2028	34.167.726	2,66
	Polnischer Zloty insgesamt			**123.314.997**	**9,59**
	Rumänischer neuer Leu				
66.350.000	Romania Government Bond*	2,50 %	25.10.2027	12.930.466	1,01
3.615.000	Romania Government Bond*	3,65 %	24.09.2031	676.963	0,05
14.600.000	Romania Government Bond*	4,15 %	24.10.2030	2.892.282	0,22
2.540.000	Romania Government Bond*	4,75 %	11.10.2034	497.902	0,04
35.830.000	Romania Government Bond**	4,85 %	25.07.2029	7.471.221	0,58
5.465.000	Romania Government Bond*	5,00 %	12.02.2029	1.150.093	0,09
8.305.000	Romania Government Bond*	6,70 %	25.02.2032	1.902.178	0,15
4.615.000	Romania Government Bond*	7,90 %	24.02.2038	1.185.285	0,09
29.040.000	Romania Government Bond*	8,25 %	29.09.2032	7.295.740	0,57
17.355.000	Romania Government Bond*	8,75 %	30.10.2028	4.250.242	0,33
	Rumänischer neuer Leu insgesamt			**40.252.372**	**3,13**
	Serbischer Dinar				
115.190.000	Serbia Treasury Bonds*	4,50 %	11.01.2026	1.069.087	0,08
80.900.000	Serbia Treasury Bonds*	4,50 %	20.08.2032	677.470	0,05

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)				
	Serbischer Dinar (Fortsetzung)				
198.550.000	Serbia Treasury Bonds*	5,88 %	08.02.2028	1.902.398	0,15
	Serbischer Dinar insgesamt			**3.648.955**	**0,28**
	Südafrikanischer Rand				
477.597.049	Republic of South Africa Government Bond*	6,25 %	31.03.2036	17.167.378	1,33
107.856.522	Republic of South Africa Government Bond*	6,50 %	28.02.2041	3.569.955	0,28
398.083.419	Republic of South Africa Government Bond*	7,00 %	28.02.2031	18.231.839	1,42
499.584.549	Republic of South Africa Government Bond*	8,50 %	31.01.2037	21.405.303	1,66
339.553.208	Republic of South Africa Government Bond*	8,75 %	31.01.2044	13.793.798	1,07
180.529.026	Republic of South Africa Government Bond*	8,75 %	28.02.2048	7.282.366	0,57
312.376.153	Republic of South Africa Government Bond*	8,88 %	28.02.2035	14.442.326	1,12
347.139.572	Republic of South Africa Government Bond*	9,00 %	31.01.2040	14.884.054	1,16
198.727.464	Republic of South Africa Government Bond*	10,50 %	21.12.2026	11.386.825	0,89
	Südafrikanischer Rand insgesamt			**122.163.844**	**9,50**
	Thailändischer Baht				
52.597.000	Thailand Government Bond**	1,60 %	17.06.2035	1.371.700	0,11
275.646.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.06.2042	6.892.770	0,54
109.097.000	Thailand Government Bond**	2,13 %	17.12.2026	3.175.339	0,25
58.000.000	Thailand Government Bond**	2,40 %	17.03.2029	1.694.561	0,13
153.400.000	Thailand Government Bond**	2,65 %	17.06.2028	4.536.441	0,35
83.000	Thailand Government Bond**	2,88 %	17.12.2028	2.480	0,00
27.836.000	Thailand Government Bond**	2,88 %	17.06.2046	747.975	0,06
315.519.000	Thailand Government Bond**	3,30 %	17.06.2038	9.652.944	0,75
350.777.000	Thailand Government Bond**	3,35 %	17.06.2033	10.833.160	0,84
171.000.000	Thailand Government Bond**	3,39 %	17.06.2037	5.307.504	0,41
196.399.000	Thailand Government Bond**	3,40 %	17.06.2036	6.079.309	0,47
91.900.000	Thailand Government Bond**	3,45 %	17.06.2043	2.825.287	0,22
234.450.000	Thailand Government Bond**	3,78 %	25.06.2032	7.424.337	0,58
5.000	Thailand Government Bond**	3,85 %	12.12.2025	151	0,00
136.225.000	Thailand Government Bond**	4,88 %	22.06.2029	4.471.500	0,35
	Thailändischer Baht insgesamt			**65.015.458**	**5,06**
	Türkische Lira				
350.599.807	Turkey Government Bond*	1,50 %	18.06.2025	12.476.481	0,97
55.104.752	Turkiye Government Bond*	17,80 %	13.07.2033	1.464.659	0,11
175.360.179	Turkiye Government Bond*	26,20 %	05.10.2033	6.175.072	0,48
	Türkische Lira insgesamt			**20.116.212**	**1,56**

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 87,45 % (31. Dezember 2022: 92,36 %) (Fortsetzung)				
	Uganda-Schilling				
22.942.900.000	Republic of Uganda Government Bonds*	14,25 %	22.06.2034	5.747.019	0,45
	Uganda-Schilling insgesamt			**5.747.019**	**0,45**
	US-Dollar				
27.119.632	Argentine Republic Government International Bond*	0,75 %	09.07.2030	10.942.954	0,85
	US-Dollar insgesamt			**10.942.954**	**0,85**
	Uruguayischer Peso				
21.091.551	Uruguay Government International Bond*	8,25 %	21.05.2031	500.924	0,04
493.856.000	Uruguay Government International Bond*	8,50 %	15.03.2028	12.211.886	0,95
44.097.716	Uruguay Government International Bond*	9,75 %	20.07.2033	1.143.276	0,09
	Uruguayischer Peso insgesamt			**13.856.086**	**1,08**
	Sambischer Kwacha				
178.877.000	Zambia Government Bond*	13,00 %	25.01.2031	4.493.148	0,35
	Sambischer Kwacha insgesamt			**4.493.148**	**0,35**
	Staatsanleihen insgesamt			**1.124.421.834**	**87,45**

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Investmentfonds 1,26 % (31. Dezember 2022: 1,09 %)		
	US-Dollar		
1.595.000	Neuberger Berman China Bond Fund	16.173.300	1,26
	Investmentfonds insgesamt [µ]	**16.173.300**	**1,26**
	Anlagen insgesamt	**1.215.761.884**	**94,55**

Devisenterminkontrakte 1,33 % (31. Dezember 2022: 1,08 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
89.346.912 BRL	17.501.222 US$	25.01.2024	Citibank NA	2	866.427	0,07
14.702.911 BRL	2.969.457 US$	03.04.2024	Deutsche Bank AG	1	31.891	0,00
7.630.442 BRL	1.546.687 US$	03.04.2024	Goldman Sachs International	1	10.938	0,00
606.214.769 BRL	122.122.234 US$	03.04.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.626.180	0,13
52.066.255 BRL	10.646.277 US$	25.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	57.335	0,01
22.452.469 BRL	4.457.437 US$	25.01.2024	Standard Chartered Bank	1	158.268	0,01
5.495.712.525 CLP	6.207.460 US$	20.03.2024	Morgan Stanley	1	60.472	0,01
91.410.500 CNY	12.872.231 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	34.296	0,00
24.087.608 CNY	3.393.660 US$	20.02.2024	Goldman Sachs International	1	475	0,00
91.410.499 CNY	12.872.836 US$	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	33.690	0,00
405.622.494 EGP	11.815.395 US$	17.01.2024	Citibank NA	1	216.954	0,02

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,33 % (31. Dezember 2022: 1,08 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
13.877.676 €	340.286.723 CZK	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	183.721	0,01
6.425.553 €	6.998.858 US$	04.01.2024	Barclays Bank Plc	3	99.404	0,01
11.465.944 €	12.560.085 US$	04.01.2024	Citibank NA	2	106.262	0,01
3.742.911 €	16.290.079 PLN	20.03.2024	Citibank NA	1	9.279	0,00
10.765.910 €	11.802.271 US$	04.01.2024	Goldman Sachs International	2	90.753	0,01
7.075.431 €	30.779.576 PLN	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	21.213	0,00
3.761.544 €	4.118.730 US$	04.01.2024	Morgan Stanley	1	36.621	0,00
751.750.972 HUF	1.949.941 €	06.02.2024	Goldman Sachs International	1	4.983	0,00
718.022.907 HUF	1.863.329 €	06.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	3.792	0,00
86.720.911.474 IDR	5.495.796 US$	07.02.2024	Deutsche Bank AG	1	128.964	0,01
19.439.282.518 IDR	1.260.736 US$	07.02.2024	Goldman Sachs International	1	106	0,00
21.637.061.564 IDR	1.395.199 US$	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	7.880	0,00
35.713.244.621 IDR	2.301.334 US$	07.02.2024	Morgan Stanley	1	15.045	0,00
6.912.528 ILS	1.864.228 US$	25.01.2024	Goldman Sachs International	1	56.284	0,01
467.429.128 INR	5.603.181 US$	08.02.2024	Standard Chartered Bank	1	4.975	0,00
8.027.103.141 KRW	6.187.689 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	31.111	0,00
7.538.158.009 KRW	5.720.247 US$	16.01.2024	Morgan Stanley	1	95.584	0,01
8.137.399.304 KRW	6.269.028 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	35.221	0,00
510.747.927 MXN	28.997.615 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	783.796	0,06
23.019.197 MXN	1.329.903 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	12.333	0,00
86.307.125 MXN	4.882.011 US$	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	150.506	0,01
25.982.566 MYR	5.497.211 US$	23.01.2024	HSBC Bank Plc	1	175.548	0,01
26.619.162 MYR	5.702.721 US$	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	103.799	0,01
64.302.318 MYR	13.862.740 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	237.462	0,02
52.926.276 MYR	11.415.153 US$	07.03.2024	Standard Chartered Bank	1	181.144	0,01
41.597.527 PEN	10.878.868 US$	18.01.2024	Barclays Bank Plc	1	350.341	0,03
308.471.592 PHP	5.505.236 US$	06.02.2024	HSBC Bank Plc	1	63.413	0,01
15.708.240 RON	3.148.499 €	19.01.2024	Citibank NA	1	6.977	0,00
19.824.355 RON	3.974.423 €	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	7.804	0,00
10.753.023 RON	2.157.713 €	19.01.2024	Standard Chartered Bank	1	2.102	0,00
7.482.812 SGD	5.501.461 US$	22.01.2024	Morgan Stanley	1	176.503	0,01
1.093.020.617 THB	31.386.821 US$	20.03.2024	Goldman Sachs International	3	851.555	0,07
403.265.137 THB	11.496.700 US$	08.01.2024	Standard Chartered Bank	1	322.696	0,03
204.811.305 THB	5.732.515 US$	16.01.2024	Standard Chartered Bank	1	274.968	0,02
680.098.291 THB	19.534.354 US$	20.03.2024	Standard Chartered Bank	1	524.979	0,04
52.986.401 THB	1.527.065 US$	20.03.2024	UBS AG	1	35.756	0,00
383.320.481 TWD	12.048.420 US$	12.01.2024	HSBC Bank Plc	1	528.976	0,04
181.961.109 TWD	5.808.443 US$	08.01.2024	Standard Chartered Bank	1	148.608	0,01
3.853.075 US$	212.982.598 PHP	20.03.2024	Citibank NA	1	8.362	0,00
6.969.417 US$	127.975.834 ZAR	20.03.2024	Citibank NA	1	18.814	0,00
5.897.297 US$	7.636.292.545 KRW	16.01.2024	HSBC Bank Plc	1	5.755	0,00

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,33 % (31. Dezember 2022: 1,08 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
3.656.499 US$	3.288.127 €	05.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	19.182	0,00
230.517.187 UYU	5.755.735 US$	27.03.2024	Citibank NA	1	100.901	0,01
191.331.729 UYU	4.774.097 US$	09.02.2024	Citibank NA	2	113.672	0,01
45.670.724 UYU	1.127.672 US$	09.02.2024	Goldman Sachs International	1	39.034	0,00
173.855.725 UYU	4.296.952 US$	09.02.2024	JPMorgan Chase Bank	2	144.374	0,01
142.061.319 ZAR	7.469.443 US$	20.03.2024	Morgan Stanley	2	246.168	0,02
Abgesicherte Klassen AUD						
734.831 AUD	494.629 US$	14.03.2024	UBS AG	1	7.875	0,00
30.232.349 AUD	19.960.970 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	13	713.012	0,06
9.767 US$	14.227 AUD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	3	39	0,00
Abgesicherte Klassen EUR						
2.781.056 €	3.014.565 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	2	66.380	0,01
25.064.872 €	27.169.744 US$	14.03.2024	UBS AG	1	597.952	0,05
1.167.042 €	1.279.363 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	8	13.526	0,00
9.426 US$	8.464 €	14.03.2024	Westpac Banking Corp	3	49	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
8.924 £	11.351 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	29	0,00
358.598 £	452.237 US$	14.03.2024	UBS AG	2	5.068	0,00
10.668 £	13.518 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	87	0,00
120 US$	94 £	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
Abgesicherte Klassen SEK						
181.022 SEK	17.725 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	288	0,00
1.113.655.977 SEK	106.652.655 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	4	4.165.171	0,32
Abgesicherte Klassen SGD						
829.746 SGD	621.662 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	3	9.443	0,00
13.950 SGD	10.471 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	5	139	0,00
4.013 US$	5.266 SGD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	8	0,00
Abgesicherte Klassen ZAR						
247 US$	4.552 ZAR	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	0	0,00
967.576.824 ZAR	50.713.365 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	3	1.865.751	0,14
10.158.611 ZAR	544.222 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	11	7.807	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**17.116.276**	**1,33**

Futures-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
43	South Korea 10-Year Bond Future March 2024	51.083	0,01
561	South Korea 3-Year Bond Future March 2024	139.390	0,01
133	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	123.195	0,01
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**313.668**	**0,03**

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte 0,89 % (31. Dezember 2022: 0,64 %)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)[#]	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
MXN	512.441.055	31.08.2029	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	6,92 %	28D MXIBTIIE	2.143.573	0,17
BRL	105.671.287	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	12,76 %	1D BROIS	2.099.472	0,16
BRL	86.253.227	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	12,67 %	1D BROIS	1.647.825	0,13
BRL	70.829.782	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	12,68 %	1D BROIS	1.362.469	0,11
CZK	251.860.308	11.04.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,70 %	6M PRIBOR	469.675	0,04
BRL	24.637.956	02.01.2030	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	11,50 %	1D BROIS	435.223	0,03
BRL	74.083.362	02.01.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	11,06 %	1D BROIS	399.634	0,03
BRL	86.110.250	02.01.2026	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	11,57 %	1D BROIS	363.178	0,03
COP	56.328.682.161	31.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	7,14 %	1D COOVIBR	279.907	0,02
BRL	67.694.701	02.01.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	10,59 %	1D BROIS	242.667	0,02
COP	85.928.260.876	13.04.2024	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	8,37 %	1D COOVIBR	229.249	0,02
BRL	65.515.347	02.01.2026	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	11,40 %	1D BROIS	225.783	0,02
CZK	136.144.314	12.10.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,39 %	6M PRIBOR	212.987	0,02
MXN	128.272.271	30.10.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	9,26 %	28D MXIBTIIE	203.043	0,01
BRL	30.505.879	02.01.2031	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	10,49 %	1D BROIS	177.545	0,01
HUF	559.561.178	10.02.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	8,72 %	6M BUBOR	176.022	0,01
COP	16.091.111.994	06.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	6,40 %	1D COOVIBR	162.171	0,01
BRL	34.373.160	02.01.2031	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	10,43 %	1D BROIS	100.729	0,01
MXN	128.662.190	17.08.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	8,94 %	28D MXIBTIIE	93.547	0,01
MXN	256.541.706	20.03.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	10,05 %	28D MXIBTIIE	86.351	0,01
MXN	128.662.192	17.08.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	8,91 %	28D MXIBTIIE	84.858	0,01
CZK	953.385.065	22.12.2025	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,47 %	6M PRIBOR	82.308	0,01
COP	7.078.194.753	07.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	6,45 %	1D COOVIBR	68.709	0,00
CZK	39.819.822	25.07.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,19 %	6M PRIBOR	44.041	0,00
CNY	91.100.000	29.08.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,30 %	7D CNRR	31.973	0,00
MXN	132.917.273	25.03.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	9,33 %	28D MXIBTIIE	31.571	0,00
CZK	7.526.455	16.10.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,30 %	6M PRIBOR	10.339	0,00
CNY	72.600.000	11.12.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,25 %	7D CNRR	7.365	0,00
CNY	109.400.000	16.08.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,28 %	7D CNRR	4.457	0,00
MYR	72.766.553	20.12.2025	Goldman Sachs International	(Zahlung)	3,50 %	3M KLIBOR	3.085	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten [∞]							**11.479.756**	**0,89**

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

[1]Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**1.244.671.584**	**96,80**

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,96 %) (31. Dezember 2022: (0,69 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
83.310.361 CNY	11.708.573 US$	10.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(2.583)	(0,00)
242.779.120 EGP	5.530.276 US$	02.04.2024	Citibank NA	1	(31.315)	(0,00)
42.843.374 EGP	982.646 US$	02.04.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(12.241)	(0,00)
3.020.865 €	15.067.428 RON	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(5.800)	(0,00)
4.357.630.352 HUF	11.371.783 €	06.02.2024	Goldman Sachs International	1	(47.091)	(0,00)
284.067.272 KRW	222.035 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	(1.961)	(0,00)
23.840.128 PLN	5.469.656 €	20.03.2024	Citibank NA	1	(4.711)	(0,00)
8.158.717 PLN	1.873.243 €	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	(3.145)	(0,00)
3.700.801 US$	3.382.238 €	05.02.2024	Barclays Bank Plc	1	(40.621)	(0,00)
13.925.691 US$	12.840.487 €	04.01.2024	Barclays Bank Plc	3	(259.103)	(0,02)
623.007 US$	21.566.583 THB	20.03.2024	BNP Paribas	1	(13.094)	(0,00)
1.453.941 US$	25.564.577 MXN	20.03.2024	BNP Paribas	1	(36.715)	(0,00)
12.929.617 US$	11.774.931 €	05.02.2024	Citibank NA	2	(95.778)	(0,01)
8.471.185 US$	32.553.069 PEN	18.01.2024	Citibank NA	1	(316.482)	(0,03)
5.949.611 US$	207.354.063 THB	16.01.2024	Citibank NA	1	(132.456)	(0,01)
5.818.921 US$	7.930.288 SGD	22.01.2024	Citibank NA	1	(198.587)	(0,02)
2.181.044 US$	38.379.551 MXN	20.03.2024	Citibank NA	1	(56.845)	(0,00)
10.105.941 US$	362.779.120 EGP	17.01.2024	Citibank NA	2	(655.505)	(0,05)
377.543 US$	492.860.026 KRW	20.03.2024	Citibank NA	1	(4.288)	(0,00)
10.320.041 US$	75.309.284 CNY	10.01.2024	Citibank NA	1	(261.713)	(0,02)
4.202.336 US$	20.641.411 BRL	03.04.2024	Deutsche Bank AG	1	(11.257)	(0,00)
2.054.344 US$	35.600.000 MXN	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	(21.471)	(0,00)
7.623.768 US$	38.626.278 BRL	25.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(316.897)	(0,03)
1.840.415 US$	9.235.129 BRL	03.04.2024	Goldman Sachs International	1	(44.779)	(0,00)
33.858.552 US$	138.010.843.904 COP	20.03.2024	Goldman Sachs International	1	(1.216.392)	(0,10)
23.446.102 US$	95.078.396.855 COP	01.02.2024	Goldman Sachs International	1	(938.486)	(0,07)
12.868.352 US$	11.903.730 €	04.01.2024	Goldman Sachs International	2	(281.614)	(0,02)
3.574.401 US$	17.844.517 BRL	03.04.2024	HSBC Bank Plc	1	(68.253)	(0,01)
1.764.501 US$	8.184.813 MYR	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	(30.264)	(0,00)
1.329.176 US$	1.734.893.361 KRW	20.03.2024	HSBC Bank Plc	2	(14.890)	(0,00)
2.730.407 US$	42.377.913.324 IDR	20.03.2024	HSBC Bank Plc	2	(17.634)	(0,00)
10.898.021 US$	443.603.947 UYU	09.02.2024	HSBC Bank Plc	1	(434.306)	(0,03)
5.754.279 US$	27.258.019 MYR	23.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(196.948)	(0,02)
2.082.203 US$	1.834.879.089 CLP	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(10.500)	(0,00)
5.143.490 US$	26.065.048 BRL	25.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(214.878)	(0,02)
1.224.096 US$	42.843.374 EGP	17.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(46.806)	(0,00)
2.330.680 US$	10.801.536 MYR	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(37.879)	(0,00)
11.462.572 US$	214.755.317 ZAR	20.03.2024	Morgan Stanley	1	(201.185)	(0,02)
11.376.285 US$	42.598.500 PEN	18.01.2024	Morgan Stanley	1	(123.135)	(0,01)
8.342.840 US$	7.674.733 €	04.01.2024	Morgan Stanley	3	(135.382)	(0,01)

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,96 %) (31. Dezember 2022: (0,69 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
1.754.748 US$	27.225.091.101 IDR	07.02.2024	Morgan Stanley	1	(11.085)	(0,00)
5.857.072 US$	181.652.983 TWD	08.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(89.892)	(0,01)
13.148.642 US$	94.639.458 CNY	20.02.2024	Standard Chartered Bank	1	(186.809)	(0,02)
10.091.436 US$	157.933.993.840 IDR	20.03.2024	Standard Chartered Bank	1	(149.964)	(0,01)
11.988.992 US$	383.659.740 TWD	12.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(599.535)	(0,05)
Abgesicherte Klassen AUD						
404.387 AUD	277.287 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	(753)	(0,00)
200 AUD	138 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
317.961 US$	477.366 AUD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	15	(8.481)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
396.855 €	440.705 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	3	(1.056)	(0,00)
295.578 US$	271.646 €	14.03.2024	Westpac Banking Corp	12	(5.360)	(0,00)
Abgesicherte Klassen GBP						
2.876 US$	2.289 £	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	(43)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SEK						
101.815 SEK	10.232 US$	14.03.2024	UBS AG	1	(101)	(0,00)
250 SEK	25 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	(0)	(0,00)
5.033 US$	52.411 SEK	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	(183)	(0,00)
105.945.439 US$	1.106.270.764 SEK	14.03.2024	Westpac Banking Corp	6	(4.137.497)	(0,33)
Abgesicherte Klassen SGD						
9.526 SGD	7.246 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	(0)	(0,00)
69.288 US$	92.492 SGD	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	(1.062)	(0,00)
3.024 US$	4.043 SGD	14.03.2024	UBS AG	1	(52)	(0,00)
22.881 US$	30.574 SGD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	4	(373)	(0,00)
Abgesicherte Klassen ZAR						
14.233.048 US$	271.729.490 ZAR	14.03.2024	Goldman Sachs International	2	(533.011)	(0,04)
638.354 US$	11.992.589 ZAR	14.03.2024	Westpac Banking Corp	18	(13.335)	(0,00)
31.806 ZAR	1.730 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(12.281.584)**	**(0,96)**

Futures-Kontrakte (0,06 %) (31. Dezember 2022: (0,05 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
(106)	Euro-BOBL Future March 2024	(4.684)	(0,00)
(55)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	(711.992)	(0,06)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(716.676)**	**(0,06)**

Zinsswap-Kontrakte (1,16 %) (31. Dezember 2022: (3,40 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
INR	1.221.633.954	19.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	6,21 %	1D MIBOR	(403)	(0,00)

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte (1,16 %) (31. Dezember 2022: (3,40 %)) (Fortsetzung)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)[#]	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
CLP	6.932.372.858	24.10.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	6,12 %	1D CLICP	(860)	(0,00)
BRL	427.249	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	11,66 %	1D BROIS	(2.388)	(0,00)
CLP	45.161.320	24.08.2030	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	2,15 %	1D CLICP	(7.739)	(0,00)
PLN	29.499.301	07.11.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,51 %	6M WIBOR	(34.010)	(0,00)
BRL	29.285.776	02.01.2029	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	10,30 %	1D BROIS	(54.647)	(0,00)
BRL	136.854.801	02.01.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	10,00 %	1D BROIS	(74.233)	(0,01)
COP	26.779.695.017	02.06.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	10,28 %	1D COOVIBR	(78.474)	(0,01)
PLN	22.853.707	10.10.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,76 %	6M WIBOR	(85.681)	(0,01)
MXN	328.685.527	03.02.2028	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	8,58 %	28D MXIBTIIE	(91.886)	(0,01)
PLN	29.194.460	01.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,72 %	6M WIBOR	(95.610)	(0,01)
PLN	8.775.179	15.05.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	5,20 %	6M WIBOR	(122.173)	(0,01)
PLN	8.775.181	15.05.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	5,22 %	6M WIBOR	(125.119)	(0,01)
MXN	34.061.309	08.12.2025	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,21 %	28D MXIBTIIE	(127.108)	(0,01)
PLN	15.280.123	02.10.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,99 %	6M WIBOR	(153.978)	(0,01)
COP	53.508.123.529	05.06.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	10,27 %	1D COOVIBR	(157.206)	(0,01)
COP	8.472.548.430	11.08.2032	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	9,02 %	1D COOVIBR	(190.036)	(0,01)
PLN	18.527.328	03.10.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	5,01 %	6M WIBOR	(194.172)	(0,01)
MXN	60.000.000	08.04.2026	Goldman Sachs International	(Zahlung)	5,95 %	28D MXIBTIIE	(258.986)	(0,02)
MXN	76.391.828	28.05.2026	JPMorgan Chase Bank	(Zahlung)	6,16 %	28D MXIBTIIE	(317.630)	(0,02)
MXN	75.000.000	18.06.2026	JPMorgan Chase Bank	(Zahlung)	6,13 %	28D MXIBTIIE	(317.726)	(0,02)
MXN	242.308.506	07.01.2028	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	8,04 %	28D MXIBTIIE	(337.123)	(0,03)
MXN	90.000.000	21.05.2026	JPMorgan Chase Bank	(Zahlung)	6,33 %	28D MXIBTIIE	(353.615)	(0,03)
MXN	94.552.835	05.03.2026	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,17 %	28D MXIBTIIE	(376.694)	(0,03)
MXN	95.000.000	16.09.2026	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,38 %	28D MXIBTIIE	(384.564)	(0,03)
BRL	21.212.260	02.01.2031	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	11,54 %	1D BROIS	(459.800)	(0,04)
PLN	11.813.679	28.10.2032	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	7,32 %	6M WIBOR	(612.444)	(0,05)
CLP	29.962.297.165	14.09.2024	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	9,80 %	1D CLICP	(743.483)	(0,06)
MXN	141.097.429	08.10.2038	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	9,77 %	28D MXIBTIIE	(894.141)	(0,07)
BRL	40.209.304	02.01.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	6,82 %	1D BROIS	(920.503)	(0,07)
BRL	107.195.155	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	5,76 %	1D BROIS	(2.617.874)	(0,20)
BRL	136.490.816	01.07.2024	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	5,92 %	1D BROIS	(4.787.449)	(0,37)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten [∞]							**(14.977.755)**	**(1,16)**

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

[1]Zentral abgewickelter Swap.

Emerging Market Debt - Local Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(27.976.015)**	**(2,18)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**1.216.695.569**	**94,62**
Sonstiges Nettovermögen	**69.172.078**	**5,38**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**1.285.867.647**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	870.284.155	65,81
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	329.304.429	24,90
µ	Investmentfonds	16.173.300	1,22
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(403.008)	(0,03)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	1.336.693	0,10
Anlagen insgesamt		**1.216.695.569**	**92,00**

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Schatzwechsel 0,19 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
	Thailändischer Baht				
34.618.000	Bank of Thailand Bill	0,00 %	09.05.2024	1.006.392	0,19
	Schatzwechsel insgesamt **			**1.006.392**	**0,19**
	Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %)				
	Kolumbianischer Peso				
899.000.000	Asian Development Bank*	11,20 %	31.01.2025	230.035	0,04
2.323.000.000	Asian Development Bank*	12,75 %	03.03.2025	607.614	0,12
2.561.000.000	Asian Development Bank*	13,00 %	07.03.2025	667.096	0,13
4.060.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	7,63 %	10.09.2024	1.009.487	0,19
17.077.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP*	8,38 %	08.11.2027	3.831.525	0,73
3.260.000.000	International Finance Corp*	0,00 %	16.08.2028	545.482	0,10
	Kolumbianischer Peso insgesamt			**6.891.239**	**1,31**
	Euro				
2.082.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*	7,13 %	19.07.2026	1.091.823	0,21
821.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	1,88 %	05.11.2031	739.337	0,14
	Euro insgesamt			**1.831.160**	**0,35**
	Mexikanischer Peso				
17.700.000	Asian Infrastructure Investment Bank*	0,00 %	08.02.2038	288.058	0,05
46.510.400	Comision Federal de Electricidad*	7,35 %	25.11.2025	2.558.589	0,49
43.963.800	Comision Federal de Electricidad*	8,18 %	23.12.2027	2.343.103	0,44
	Mexikanischer Peso insgesamt			**5.189.750**	**0,98**
	US-Dollar				
537.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	4,50 %	14.09.2027	528.438	0,10
600.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	5,38 %	18.07.2028	609.511	0,12
359.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC**	8,00 %	29.12.2049	382.064	0,07
1.439.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60 %	02.11.2047	1.324.352	0,25
200.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC*	2,00 %	29.04.2028	180.650	0,03
351.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC*	4,70 %	24.04.2033	356.256	0,07
245.405	Acu Petroleo Luxembourg Sarl**	7,50 %	13.01.2032	233.050	0,04
436.000	Adani Electricity Mumbai Ltd**	3,95 %	12.02.2030	357.528	0,07
600.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ*	6,25 %	10.12.2024	593.638	0,11
362.000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA**	5,13 %	11.08.2061	276.106	0,05
538.000	Africa Finance Corp*	2,88 %	28.04.2028	472.095	0,09
200.000	AIA Group Ltd*	3,20 %	16.09.2040	151.942	0,03
250.000	AIA Group Ltd**	3,38 %	07.04.2030	230.468	0,04
300.000	AIA Group Ltd**	3,60 %	09.04.2029	283.957	0,05
200.000	AIA Group Ltd**	4,95 %	04.04.2033	201.530	0,04

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
400.000	Akbank TAS*	5,13 %	31.03.2025	396.101	0,08
400.000	Akbank TAS**	6,80 %	06.02.2026	402.438	0,08
400.000	Aldar Investment Properties Sukuk Ltd*	4,88 %	24.05.2033	390.486	0,07
837.741	Alfa Desarrollo SpA**	4,55 %	27.09.2051	654.844	0,12
600.000	Alfa SAB de CV**	6,88 %	25.03.2044	598.666	0,11
394.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,00 %	06.12.2037	338.906	0,06
300.000	Alsea SAB de CV**	7,75 %	14.12.2026	306.538	0,06
450.000	Altice Financing SA**	5,75 %	15.08.2029	400.327	0,08
300.000	America Movil SAB de CV*	3,63 %	22.04.2029	283.499	0,05
300.000	America Movil SAB de CV*	4,70 %	21.07.2032	295.097	0,06
625.000	Anglo American Capital Plc*	3,88 %	16.03.2029	586.809	0,11
400.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc*	3,38 %	01.11.2028	360.348	0,07
310.000	Antofagasta Plc*	5,63 %	13.05.2032	311.987	0,06
500.000	Axis Bank Ltd*	4,10 %	29.12.2049	456.791	0,09
175.000	Azul Secured Finance LLP**	10,88 %	28.05.2030	144.827	0,03
200.000	Banco Bradesco SA**	4,38 %	18.03.2027	194.509	0,04
635.000	Banco Davivienda SA**	6,65 %	29.12.2049	454.819	0,09
650.000	Banco de Bogota SA*	6,25 %	12.05.2026	642.287	0,12
400.000	Banco de Chile**	2,99 %	09.12.2031	344.637	0,07
250.000	Banco de Credito del Peru SA**	3,13 %	01.07.2030	238.016	0,05
775.000	Banco de Credito e Inversiones SA**	2,88 %	14.10.2031	657.727	0,12
500.000	Banco do Brasil SA**	6,25 %	18.04.2030	520.643	0,10
200.000	Banco Mercantil del Norte SA*	7,50 %	29.12.2049	188.942	0,04
500.000	Banco Mercantil del Norte SA*	7,63 %	29.12.2049	481.066	0,09
400.000	Banco Santander Chile**	3,18 %	26.10.2031	346.810	0,07
400.000	Bancolombia SA*	4,63 %	18.12.2029	371.094	0,07
1.000.000	Bangkok Bank PCL**	3,73 %	25.09.2034	889.610	0,17
402.000	Bangkok Bank PCL*	4,30 %	15.06.2027	394.151	0,07
854.000	Bangkok Bank PCL**	5,00 %	29.12.2049	818.405	0,16
300.000	Bank Hapoalim BM*	3,26 %	21.01.2032	260.787	0,05
500.000	Bank Leumi Le-Israel BM**	3,28 %	29.01.2031	453.225	0,09
418.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**	3,75 %	30.03.2026	399.935	0,08
500.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	4,30 %	29.12.2049	444.266	0,08
1.708.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	4,70 %	22.10.2031	1.459.640	0,28
550.000	BBVA Bancomer SA**	5,13 %	18.01.2033	498.735	0,09
400.000	Bidvest Group UK Plc*	3,63 %	23.09.2026	372.000	0,07
800.000	BOC Aviation Ltd*	3,00 %	11.09.2029	720.044	0,14
274.000	BOC Aviation Ltd**	3,50 %	18.09.2027	260.780	0,05
350.000	BOC Aviation Ltd*	4,50 %	23.05.2028	343.613	0,07
200.000	Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**	10,00 %	15.11.2028	209.000	0,04

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
375.000	Braskem Idesa SAPI**	6,99 %	20.02.2032	212.179	0,04
523.500	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais**	5,33 %	15.02.2028	515.820	0,10
550.000	BRF SA**	4,88 %	24.01.2030	484.221	0,09
665.000	BSF Finance*	5,50 %	23.11.2027	675.806	0,13
263.000	Canacol Energy Ltd**	5,75 %	24.11.2028	192.052	0,04
500.000	CBQ Finance Ltd*	2,00 %	15.09.2025	470.790	0,09
400.000	CBQ Finance Ltd*	2,00 %	12.05.2026	369.224	0,07
300.000	CDBL Funding 2*	2,00 %	04.03.2026	282.143	0,05
300.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA**	4,25 %	30.04.2029	280.079	0,05
500.000	Cemex SAB de CV**	5,13 %	29.12.2049	474.591	0,09
622.000	Cemex SAB de CV**	9,13 %	29.12.2049	663.208	0,13
400.000	Cencosud SA*	4,38 %	17.07.2027	386.186	0,07
645.000	Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**	5,25 %	27.04.2029	606.390	0,11
300.000	Champion Path Holdings Ltd**	4,85 %	27.01.2028	258.472	0,05
300.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd*	4,75 %	08.02.2028	293.584	0,06
300.000	China Construction Bank Corp*	2,45 %	24.06.2030	287.421	0,05
300.000	China Overseas Finance Cayman VI Ltd**	5,95 %	08.05.2024	300.086	0,06
531.000	Cia Cervecerias Unidas SA**	3,35 %	19.01.2032	457.650	0,09
400.000	Cia de Minas Buenaventura SAA**	5,50 %	23.07.2026	382.217	0,07
410.000	Cibanco SA Ibm/PLA Administradora Industrial S de RL de CV**	4,96 %	18.07.2029	391.631	0,07
400.000	CK Hutchison International 23 Ltd*	4,88 %	21.04.2033	401.617	0,08
200.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88 %	12.08.2025	189.736	0,04
150.000	Coca-Cola Femsa SAB de CV*	1,85 %	01.09.2032	119.445	0,02
214.000	Colbun SA**	3,15 %	19.01.2032	185.406	0,04
669.000	Comision Federal de Electricidad*	3,35 %	09.02.2031	559.481	0,11
664.000	Comision Federal de Electricidad*	4,69 %	15.05.2029	625.606	0,12
275.000	Comision Federal de Electricidad*	6,26 %	15.02.2052	241.595	0,05
800.000	Commercial Bank PSQC*	4,50 %	29.12.2049	733.928	0,14
356.500	Continuum Energy Levanter Pte Ltd**	4,50 %	09.02.2027	335.508	0,06
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	5,13 %	02.02.2033	194.152	0,04
211.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	5,95 %	08.01.2034	214.454	0,04
800.000	CSN Resources SA**	4,63 %	10.06.2031	655.034	0,13
544.000	CT Trust**	5,13 %	03.02.2032	476.031	0,09
600.000	DIB Sukuk Ltd*	2,95 %	16.01.2026	575.417	0,11
489.000	DIB Sukuk Ltd*	4,80 %	16.08.2028	485.587	0,09
692.000	DIB Sukuk Ltd*	5,49 %	30.11.2027	705.935	0,13
497.000	DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd*	6,25 %	29.12.2049	495.817	0,09
1.190.000	DP World Ltd*	6,85 %	02.07.2037	1.316.445	0,25
451.000	Ecopetrol SA**	5,88 %	28.05.2045	356.748	0,07
500.000	Ecopetrol SA**	6,88 %	29.04.2030	496.093	0,09
599.000	Ecopetrol SA*	8,88 %	13.01.2033	651.506	0,12

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
200.000	EIG Pearl Holdings Sarl*	3,55 %	31.08.2036	174.675	0,03
300.000	EIG Pearl Holdings Sarl*	4,39 %	30.11.2046	241.620	0,05
300.000	Emaar Sukuk Ltd**	3,64 %	15.09.2026	287.329	0,05
200.000	Embraer Netherlands Finance BV**	7,00 %	28.07.2030	209.999	0,04
720.000	Emirates NBD Bank PJSC*	5,88 %	11.10.2028	745.229	0,14
600.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13 %	29.12.2049	597.402	0,11
550.000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado*	3,07 %	18.08.2050	335.443	0,06
941.000	Empresa de Transmision Electrica SA*	5,13 %	02.05.2049	683.961	0,13
362.000	Empresa Nacional del Petroleo**	3,45 %	16.09.2031	305.494	0,06
440.000	Empresa Nacional del Petroleo**	3,75 %	05.08.2026	418.434	0,08
206.000	Empresa Nacional del Petroleo**	4,50 %	14.09.2047	155.777	0,03
400.000	Endeavour Mining Plc**	5,00 %	14.10.2026	370.752	0,07
100.000	Energean Israel Finance Ltd**	5,88 %	30.03.2031	84.672	0,02
403.425	Energian Israel Finance Ltd**	4,88 %	30.03.2026	372.866	0,07
650.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38 %	12.05.2026	609.954	0,12
700.000	ENN Energy Holdings Ltd**	2,63 %	17.09.2030	599.534	0,11
700.000	First Abu Dhabi Bank PJSC*	6,32 %	04.04.2034	722.068	0,14
400.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	15.10.2027	340.500	0,06
320.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50 %	01.04.2025	305.410	0,06
500.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25 %	23.07.2029	325.734	0,06
550.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00 %	15.12.2025	564.419	0,11
700.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63 %	31.03.2036	578.960	0,11
746.496	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,94 %	30.09.2040	615.579	0,12
433.000	GC Treasury Center Co Ltd*	2,98 %	18.03.2031	366.446	0,07
800.000	GC Treasury Center Co Ltd*	4,40 %	30.03.2032	731.188	0,14
324.000	GCC SAB de CV**	3,61 %	20.04.2032	279.418	0,05
700.000	GENM Capital Labuan Ltd*	3,88 %	19.04.2031	597.868	0,11
700.000	Globe Telecom Inc*	4,20 %	29.12.2049	662.860	0,13
241.000	Gohl Capital Ltd*	4,25 %	24.01.2027	232.128	0,04
408.850	Greenko Dutch BV**	3,85 %	29.03.2026	381.631	0,07
450.000	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	406.800	0,08
427.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl*	6,51 %	23.02.2042	451.562	0,09
550.000	Grupo Aval Ltd*	4,38 %	04.02.2030	467.609	0,09
600.000	Grupo de Inversiones Suramericana SA*	5,50 %	29.04.2026	589.520	0,11
200.000	Grupo Televisa SAB*	6,63 %	15.01.2040	209.634	0,04
273.316	Guara Norte Sarl**	5,20 %	15.06.2034	249.292	0,05
300.000	Gulf International Bank BSC*	2,38 %	23.09.2025	281.504	0,05
500.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd**	3,38 %	04.02.2032	461.241	0,09
600.000	HDFC Bank Ltd**	3,70 %	29.12.2049	547.529	0,10
200.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,25 %	07.11.2027	182.804	0,03
500.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	495.625	0,09

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
200.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	8,55 %	18.09.2033	218.883	0,04
557.000	Hyundai Capital America**	2,75 %	27.09.2026	520.371	0,10
200.000	Hyundai Capital America**	5,68 %	26.06.2028	203.999	0,04
700.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00 %	18.09.2027	625.772	0,12
400.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT**	3,54 %	27.04.2032	346.459	0,07
400.000	InRetail Consumer**	3,25 %	22.03.2028	359.294	0,07
333.000	Inversiones CMPC SA**	6,13 %	23.06.2033	344.997	0,07
200.000	Itau Unibanco Holding SA*	3,88 %	15.04.2031	191.697	0,04
161.000	JSW Hydro Energy Ltd*	4,13 %	18.05.2031	140.454	0,03
300.000	JSW Steel Ltd*	5,05 %	05.04.2032	259.062	0,05
200.000	Kallpa Generacion SA*	4,13 %	16.08.2027	191.322	0,04
400.000	Kasikornbank PCL*	3,34 %	02.10.2031	368.444	0,07
408.000	Kasikornbank PCL*	5,46 %	07.03.2028	416.184	0,08
200.000	KazMunayGas National Co JSC*	3,50 %	14.04.2033	166.715	0,03
350.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,38 %	24.04.2030	347.840	0,07
1.885.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,75 %	19.04.2047	1.657.051	0,31
200.000	Klabin Austria GmbH**	3,20 %	12.01.2031	167.681	0,03
300.000	Klabin Austria GmbH*	7,00 %	03.04.2049	303.502	0,06
200.000	KOC Holding AS*	6,50 %	11.03.2025	199.565	0,04
700.000	Kookmin Bank**	2,50 %	04.11.2030	583.398	0,11
600.000	Kosmos Energy Ltd*	7,13 %	04.04.2026	572.584	0,11
300.000	Kyobo Life Insurance Co Ltd*	5,90 %	15.06.2052	296.109	0,06
118.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2029	135.246	0,03
500.000	Lenovo Group Ltd*	3,42 %	02.11.2030	441.861	0,08
356.985	Leviathan Bond Ltd*	6,50 %	30.06.2027	336.702	0,06
275.000	Longfor Group Holdings Ltd**	3,95 %	16.09.2029	127.471	0,02
700.000	MAF Global Securities Ltd*	7,88 %	29.12.2049	716.058	0,14
670.000	MARB BondCo Plc*	3,95 %	29.01.2031	544.828	0,10
541.101	MC Brazil Downstream Trading Sarl**	7,25 %	30.06.2031	424.732	0,08
364.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	4,38 %	22.11.2033	355.023	0,07
200.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	5,88 %	01.05.2034	218.658	0,04
750.000	Medco Bell Pte Ltd**	6,38 %	30.01.2027	714.609	0,14
400.000	MEGlobal Canada ULC*	5,00 %	18.05.2025	395.980	0,07
300.000	MEGlobal Canada ULC*	5,88 %	18.05.2030	309.268	0,06
200.000	Meituan*	3,05 %	28.10.2030	168.956	0,03
600.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63 %	17.07.2027	562.870	0,11
500.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,75 %	21.07.2028	463.512	0,09
474.000	Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS*	8,25 %	15.11.2028	495.553	0,09
885.000	Mexico City Airport Trust*	5,50 %	31.07.2047	764.936	0,15
250.000	Millicom International Cellular SA**	4,50 %	27.04.2031	207.935	0,04
540.000	Millicom International Cellular SA*	5,13 %	15.01.2028	503.544	0,10

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
180.000	Millicom International Cellular SA*	6,25 %	25.03.2029	170.778	0,03
900.000	Minera Mexico SA de CV**	4,50 %	26.01.2050	726.674	0,14
600.000	Minerva Luxembourg SA**	8,88 %	13.09.2033	635.426	0,12
450.000	Minsur SA**	4,50 %	28.10.2031	398.219	0,08
240.000	MSU Energy SA/UGEN SA/UENSA SA**	6,88 %	01.02.2025	183.240	0,03
350.000	MTR Corp Ltd**	1,63 %	19.08.2030	292.496	0,06
353.992	MV24 Capital BV*	6,75 %	01.06.2034	331.625	0,06
345.077	Nakilat Inc**	6,07 %	31.12.2033	356.594	0,07
300.000	Nanyang Commercial Bank Ltd*	3,80 %	20.11.2029	293.267	0,06
700.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*	4,50 %	29.12.2049	673.159	0,13
400.000	Nemak SAB de CV**	3,63 %	28.06.2031	332.589	0,06
400.000	Nexa Resources SA**	5,38 %	04.05.2027	390.799	0,07
469.000	NWD MTN Ltd**	4,13 %	18.07.2029	357.866	0,07
320.000	Oil & Gas Holding Co BSCC**	7,50 %	25.10.2027	338.666	0,06
470.000	Oil & Gas Holding Co BSCC*	8,38 %	07.11.2028	517.188	0,10
545.000	Ooredoo International Finance Ltd*	2,63 %	08.04.2031	476.165	0,09
600.000	Orbia Advance Corp SAB de CV**	6,75 %	19.09.2042	601.183	0,11
300.000	Oryx Funding Ltd**	5,80 %	03.02.2031	301.575	0,06
800.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**	1,83 %	10.09.2030	752.834	0,14
394.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	4,60 %	15.06.2032	389.398	0,07
400.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63 %	24.04.2028	419.150	0,08
600.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	592.643	0,11
339.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	4,38 %	05.02.2050	281.017	0,05
510.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	5,25 %	15.05.2047	478.918	0,09
1.230.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	6,15 %	21.05.2048	1.263.216	0,24
300.000	Petrobras Global Finance BV*	5,50 %	10.06.2051	253.190	0,05
429.000	Petrobras Global Finance BV*	6,50 %	03.07.2033	435.968	0,08
13.366.824	Petroleos de Venezuela SA*	6,00 %	16.05.2024	1.536.889	0,29
12.004.188	Petroleos de Venezuela SA**	6,00 %	15.11.2026	1.395.487	0,26
723.000	Petroleos del Peru SA*	4,75 %	19.06.2032	519.554	0,10
1.870.000	Petroleos del Peru SA*	5,63 %	19.06.2047	1.153.743	0,22
474.000	Petroleos Mexicanos**	5,95 %	28.01.2031	379.079	0,07
2.724.000	Petroleos Mexicanos**	7,69 %	23.01.2050	1.940.671	0,38
300.000	Petrorio Luxembourg Trading Sarl**	6,13 %	09.06.2026	294.806	0,06
300.000	Power Finance Corp Ltd*	3,95 %	23.04.2030	277.774	0,05
600.000	Prosus NV*	3,83 %	08.02.2051	377.398	0,07
550.000	Prudential Funding Asia Plc*	2,95 %	03.11.2033	484.382	0,09
825.000	QNB Finance Ltd*	2,63 %	12.05.2025	793.483	0,15
300.000	REC Ltd*	2,25 %	01.09.2026	277.371	0,05
400.000	Rede D'or Finance Sarl**	4,50 %	22.01.2030	362.904	0,07
475.000	Reliance Industries Ltd*	2,88 %	12.01.2032	407.303	0,08

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
359.000	Reliance Industries Ltd*	3,63 %	12.01.2052	263.821	0,05
500.000	ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries**	4,50 %	14.07.2028	444.804	0,08
580.000	SA Global Sukuk Ltd*	2,69 %	17.06.2031	514.640	0,10
300.000	SABIC Capital I BV*	2,15 %	14.09.2030	256.904	0,05
295.000	Sagicor Financial Co Ltd**	5,30 %	13.05.2028	283.513	0,05
430.000	Samarco Mineracao SA**	9,50 %	30.06.2031	361.630	0,07
360.000	Sands China Ltd**	4,30 %	08.01.2026	345.954	0,07
497.000	Sands China Ltd*	5,38 %	08.08.2025	490.439	0,09
1.000.000	Sands China Ltd**	5,65 %	08.08.2028	992.273	0,19
800.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50 %	27.09.2028	762.986	0,14
393.000	Sasol Financing USA LLC*	8,75 %	03.05.2029	401.380	0,08
1.485.000	Saudi Arabian Oil Co*	4,25 %	16.04.2039	1.331.579	0,25
1.095.000	Saudi Arabian Oil Co*	4,38 %	16.04.2049	944.492	0,18
200.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*	4,72 %	27.09.2028	201.228	0,04
200.000	Saudi Electricity Sukuk Programme Co*	5,68 %	11.04.2053	205.745	0,04
700.000	SEPLAT Energy Plc*	7,75 %	01.04.2026	645.400	0,12
513.000	SF Holding Investment 2021 Ltd*	3,13 %	17.11.2031	445.751	0,08
353.000	Shelf Drilling Holdings Ltd**	9,63 %	15.04.2029	345.696	0,07
1.298.000	Shinhan Bank Co Ltd*	4,38 %	13.04.2032	1.203.397	0,23
300.000	SierraCol Energy Andina LLC**	6,00 %	15.06.2028	252.732	0,05
300.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd**	4,75 %	05.08.2029	20.250	0,00
400.000	Sitios Latinoamerica SAB de CV**	5,38 %	04.04.2032	372.219	0,07
293.000	SK Hynix Inc*	6,38 %	17.01.2028	302.841	0,06
500.000	SK Hynix Inc*	6,50 %	17.01.2033	528.276	0,10
400.000	SNB Sukuk Ltd*	2,34 %	19.01.2027	370.218	0,07
1.831.000	Southern Gas Corridor CJSC*	6,88 %	24.03.2026	1.862.676	0,35
200.000	Standard Chartered Plc*	1,46 %	14.01.2027	183.334	0,03
579.000	Standard Chartered Plc*	6,30 %	06.07.2034	608.476	0,12
2.086.000	State Oil Co of the Azerbaijan Republic*	6,95 %	18.03.2030	2.199.426	0,41
300.000	Studio City Finance Ltd**	6,00 %	15.07.2025	293.965	0,06
300.000	Studio City Finance Ltd*	6,50 %	15.01.2028	278.648	0,05
400.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd**	3,75 %	25.02.2029	376.438	0,07
604.000	Suzano Austria GmbH**	7,00 %	16.03.2047	639.431	0,12
400.000	Telecom Argentina SA**	8,00 %	18.07.2026	379.911	0,07
600.000	Telecomunicaciones Digitales SA**	4,50 %	30.01.2030	517.740	0,10
700.000	Telefonica Celular del Paraguay SA**	5,88 %	15.04.2027	682.080	0,13
400.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24 %	03.06.2050	267.083	0,05
200.000	Tencent Holdings Ltd**	3,68 %	22.04.2041	157.441	0,03
600.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	3,25 %	15.08.2030	495.852	0,09
300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	3,15 %	01.10.2026	277.990	0,05
800.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	4,10 %	01.10.2046	542.634	0,10

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 28,11 % (31. Dezember 2022: 31,88 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
400.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**	8,13 %	15.09.2031	436.732	0,08
834.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75 %	18.06.2050	588.415	0,11
750.000	TNB Global Ventures Capital Bhd*	4,85 %	01.11.2028	746.936	0,14
300.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV*	6,38 %	20.09.2028	122.259	0,02
200.000	Transportadora de Gas del Sur SA*	6,75 %	02.05.2025	191.503	0,04
200.000	Trust Fibra Uno**	5,25 %	15.12.2024	197.999	0,04
200.000	Trust Fibra Uno**	6,95 %	30.01.2044	172.760	0,03
200.000	TSMC Arizona Corp*	2,50 %	25.10.2031	172.286	0,03
600.000	TSMC Arizona Corp*	4,25 %	22.04.2032	591.637	0,11
400.000	Turk Telekomunikasyon AS*	4,88 %	19.06.2024	393.500	0,07
300.000	Turk Telekomunikasyon AS*	6,88 %	28.02.2025	297.450	0,06
400.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*	5,80 %	11.04.2028	380.384	0,07
300.000	Turkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50 %	18.10.2024	295.467	0,06
400.000	Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS*	6,95 %	14.03.2026	399.248	0,08
600.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	5,50 %	01.10.2026	575.955	0,11
773.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	9,00 %	12.10.2028	812.531	0,15
955.000	United Overseas Bank Ltd*	2,00 %	14.10.2031	870.495	0,17
428.000	United Overseas Bank Ltd*	3,86 %	07.10.2032	409.498	0,08
228.000	Vale Overseas Ltd*	3,75 %	08.07.2030	210.081	0,04
455.000	Vale Overseas Ltd*	6,13 %	12.06.2033	472.822	0,09
350.000	Vale Overseas Ltd*	6,88 %	21.11.2036	382.263	0,07
750.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95 %	11.03.2025	558.405	0,11
250.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	220.945	0,04
100.000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc*	6,80 %	22.11.2025	6.909	0,00
837.000	VTR Finance NV**	6,38 %	15.07.2028	219.136	0,04
600.000	WE Soda Investments Holding Plc**	9,50 %	06.10.2028	620.880	0,12
200.000	Woori Bank*	4,88 %	26.01.2028	200.938	0,04
1.200.000	Wynn Macau Ltd*	5,63 %	26.08.2028	1.112.489	0,21
350.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS*	5,85 %	21.06.2024	349.671	0,07
660.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS**	9,25 %	16.10.2028	700.791	0,13
400.000	YPF SA*	6,95 %	21.07.2027	358.309	0,07
575.000	YPF SA**	7,00 %	15.12.2047	434.962	0,08
500.000	YPF SA*	8,50 %	28.07.2025	483.191	0,09
	US-Dollar insgesamt			**134.165.703**	**25,47**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**148.077.852**	**28,11**
	Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %)				
	Chilenischer Peso				
1.122.328.020	Bonos de la Tesoreria de la Republica*	1,90 %	01.09.2030	1.263.267	0,24
320.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	4,70 %	01.09.2030	359.049	0,07
420.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	5,00 %	01.03.2035	480.910	0,09

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)				
	Chilenischer Peso (Fortsetzung)				
5.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	5,10 %	15.07.2050	5.726	0,00
865.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	6,00 %	01.04.2033	1.057.616	0,20
335.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	7,00 %	01.05.2034	439.875	0,09
	Chilenischer Peso insgesamt			**3.606.443**	**0,69**
	Chinesischer Yuan Renminbi				
16.000.000	China Government Bond**	1,99 %	09.04.2025	2.250.543	0,43
7.000.000	China Government Bond**	2,40 %	15.07.2028	986.958	0,19
3.000.000	China Government Bond**	2,52 %	25.08.2033	421.136	0,08
5.400.000	China Government Bond**	2,60 %	15.09.2030	764.865	0,14
7.000.000	China Government Bond**	2,62 %	25.09.2029	993.500	0,19
6.800.000	China Government Bond**	2,62 %	25.06.2030	963.937	0,18
2.000.000	China Government Bond**	2,64 %	15.01.2028	284.943	0,05
8.800.000	China Government Bond**	2,67 %	25.05.2033	1.249.198	0,24
8.600.000	China Government Bond**	2,75 %	15.06.2029	1.229.376	0,23
3.000.000	China Government Bond**	2,80 %	24.03.2029	429.987	0,08
7.000.000	China Government Bond**	2,80 %	25.03.2030	1.002.126	0,19
3.900.000	China Government Bond**	2,80 %	15.11.2032	558.944	0,11
400.000	China Government Bond**	2,88 %	25.02.2033	57.794	0,01
8.000.000	China Government Bond**	2,91 %	14.10.2028	1.154.844	0,22
1.000.000	China Government Bond**	3,00 %	15.10.2053	146.111	0,03
3.000.000	China Government Bond**	3,01 %	13.05.2028	434.302	0,08
12.800.000	China Government Bond**	3,02 %	22.10.2025	1.832.637	0,35
3.000.000	China Government Bond**	3,02 %	27.05.2031	437.019	0,08
6.000.000	China Government Bond**	3,13 %	21.11.2029	877.913	0,17
3.050.000	China Government Bond**	3,19 %	15.04.2053	457.783	0,09
5.000.000	China Government Bond**	3,27 %	19.11.2030	741.184	0,14
3.650.000	China Government Bond**	3,72 %	12.04.2051	595.797	0,11
6.400.000	China Government Bond**	3,81 %	14.09.2050	1.057.817	0,20
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt			**18.928.714**	**3,59**
	Kolumbianischer Peso				
8.832.900.000	Colombian TES*	5,75 %	03.11.2027	2.021.261	0,38
41.141.900.000	Colombian TES*	6,00 %	28.04.2028	9.375.340	1,78
4.690.100.000	Colombian TES*	7,00 %	30.06.2032	1.015.321	0,19
3.417.700.000	Colombian TES*	7,25 %	18.10.2034	726.857	0,14
6.013.100.000	Colombian TES*	7,75 %	18.09.2030	1.415.733	0,27
5.092.800.000	Colombian TES*	9,25 %	28.05.2042	1.193.700	0,23
12.958.400.000	Colombian TES*	13,25 %	09.02.2033	3.972.907	0,75
2.356.900.000	Colombian TES Series G*	7,00 %	26.03.2031	525.190	0,10
171.000.000	Financiera de Desarrollo Territorial SA Findeter*	7,88 %	12.08.2024	42.569	0,01
	Kolumbianischer Peso insgesamt			**20.288.878**	**3,85**

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)				
	Tschechische Krone				
56.660.000	Czech Republic Government Bond*	0,05 %	29.11.2029	2.051.093	0,39
43.790.000	Czech Republic Government Bond*	0,25 %	10.02.2027	1.752.493	0,33
75.850.000	Czech Republic Government Bond*	1,00 %	26.06.2026	3.150.468	0,60
71.790.000	Czech Republic Government Bond*	1,20 %	13.03.2031	2.711.379	0,51
7.530.000	Czech Republic Government Bond*	1,50 %	24.04.2040	242.578	0,05
6.760.000	Czech Republic Government Bond*	1,95 %	30.07.2037	243.879	0,05
30.900.000	Czech Republic Government Bond*	2,00 %	13.10.2033	1.190.363	0,23
23.780.000	Czech Republic Government Bond*	2,50 %	25.08.2028	1.010.191	0,19
43.050.000	Czech Republic Government Bond*	2,75 %	23.07.2029	1.831.151	0,35
16.820.000	Czech Republic Government Bond*	4,20 %	04.12.2036	784.158	0,15
16.750.000	Czech Republic Government Bond*	6,20 %	16.06.2031	874.088	0,16
	Tschechische Krone insgesamt			**15.841.841**	**3,01**
	Peso Dominikanische Republik				
36.550.000	Dominican Republic International Bond*	9,75 %	05.06.2026	630.011	0,12
33.450.000	Dominican Republic International Bond*	11,25 %	15.09.2035	623.041	0,12
9.650.000	Dominican Republic International Bond*	13,63 %	03.02.2033	202.677	0,04
	Peso Dominikanische Republik insgesamt			**1.455.729**	**0,28**
	Euro				
345.561	Argentine Republic Government International Bond*	0,13 %	09.07.2030	138.241	0,03
456.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	5,13 %	22.02.2033	548.878	0,10
166.000	Benin Government International Bond*	4,88 %	19.01.2032	150.563	0,03
413.000	Benin Government International Bond*	4,95 %	22.01.2035	360.699	0,07
136.000	Benin Government International Bond*	6,88 %	19.01.2052	118.699	0,02
273.841	Chile Government International Bond*	4,13 %	05.07.2034	309.653	0,06
1.740.000	Egypt Government International Bond*	6,38 %	11.04.2031	1.238.957	0,23
300.000	Indonesia Government International Bond*	1,10 %	12.03.2033	263.029	0,05
468.000	Indonesia Government International Bond*	1,30 %	23.03.2034	407.274	0,08
922.000	Indonesia Government International Bond*	1,40 %	30.10.2031	866.045	0,16
240.000	Indonesia Government International Bond*	3,75 %	14.06.2028	267.472	0,05
2.093.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,63 %	22.03.2048	1.849.626	0,35
1.920.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,88 %	17.10.2040	1.780.943	0,34
950.000	Kazakhstan Government International Bond*	1,50 %	30.09.2034	841.303	0,16
181.000	Magyar Export-Import Bank Zrt*	6,00 %	16.05.2029	212.656	0,04
1.145.000	Peruvian Government International Bond*	1,25 %	11.03.2033	995.917	0,19
835.000	Peruvian Government International Bond*	1,95 %	17.11.2036	697.787	0,13
400.000	Philippine Government International Bond*	1,75 %	28.04.2041	309.993	0,06
987.877	Provincia de Buenos Aires*	4,50 %	01.09.2037	378.868	0,07
615.000	Republic of Cameroon International Bond*	5,95 %	07.07.2032	503.338	0,10

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
204.000	Republic of Poland Government International Bond*	4,25 %	14.02.2043	238.237	0,04
1.179.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	28.01.2032	1.011.343	0,19
186.000	Romanian Government International Bond*	2,63 %	02.12.2040	138.644	0,03
322.000	Romanian Government International Bond*	2,88 %	13.04.2042	241.461	0,05
2.266.000	Romanian Government International Bond*	3,38 %	28.01.2050	1.714.649	0,33
1.314.000	Romanian Government International Bond*	3,75 %	07.02.2034	1.255.141	0,24
144.000	Romanian Government International Bond*	6,38 %	18.09.2033	168.537	0,03
1.207.000	Serbia International Bond*	1,50 %	26.06.2029	1.129.258	0,21
566.000	Serbia International Bond*	1,65 %	03.03.2033	463.773	0,09
1.072.000	Serbia International Bond*	2,05 %	23.09.2036	827.029	0,16
412.000	Serbia International Bond*	3,13 %	15.05.2027	436.466	0,08
488.000	Tunisian Republic*	5,63 %	17.02.2024	521.878	0,10
417.000	Tunisian Republic*	6,38 %	15.07.2026	322.878	0,06
	Euro insgesamt			**20.709.235**	**3,93**
	Ghanaischer Cedi				
1.545.051	Republic of Ghana Government Bonds*	8,35 %	16.02.2027	72.130	0,01
1.546.190	Republic of Ghana Government Bonds*	8,50 %	15.02.2028	62.435	0,01
1.444.175	Republic of Ghana Government Bonds*	8,65 %	13.02.2029	51.685	0,01
1.445.239	Republic of Ghana Government Bonds*	8,80 %	12.02.2030	46.999	0,01
1.446.303	Republic of Ghana Government Bonds*	8,95 %	11.02.2031	43.518	0,01
1.447.366	Republic of Ghana Government Bonds*	9,10 %	10.02.2032	41.178	0,01
1.448.430	Republic of Ghana Government Bonds*	9,25 %	08.02.2033	39.521	0,01
	Ghanaischer Cedi insgesamt			**357.466**	**0,07**
	Ungarischer Forint				
167.210.000	Hungary Government Bond*	3,00 %	27.10.2027	440.569	0,08
492.660.000	Hungary Government Bond*	3,25 %	22.10.2031	1.210.814	0,23
297.370.000	Hungary Government Bond*	4,50 %	23.03.2028	819.397	0,16
1.037.820.000	Hungary Government Bond*	4,75 %	24.11.2032	2.767.321	0,52
364.860.000	Hungary Government Bond*	5,50 %	24.06.2025	1.042.861	0,20
413.150.000	Hungary Government Bond*	9,50 %	21.10.2026	1.294.328	0,25
	Ungarischer Forint insgesamt			**7.575.290**	**1,44**
	Indonesische Rupiah				
8.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,25 %	15.06.2036	505.326	0,10
54.982.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.08.2028	3.567.008	0,68
2.100.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.04.2032	134.530	0,03
1.800.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.07.2037	115.467	0,02
37.883.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63 %	15.05.2033	2.469.148	0,47
38.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63 %	15.02.2034	2.470.116	0,47

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)				
	Indonesische Rupie (Fortsetzung)				
44.347.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,88 %	15.04.2029	2.926.634	0,55
12.300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.05.2027	812.541	0,15
54.048.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.02.2033	3.640.929	0,69
36.979.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2038	2.517.140	0,48
9.750.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2042	659.057	0,12
20.998.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2043	1.418.131	0,27
16.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.08.2032	1.100.924	0,21
420.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.06.2035	28.906	0,01
13.390.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.04.2040	928.948	0,18
3.824.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2029	267.837	0,05
23.241.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2036	1.697.288	0,32
38.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.09.2026	2.589.274	0,49
917.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.03.2034	66.612	0,01
17.761.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,75 %	15.05.2031	1.291.130	0,24
	Indonesische Rupiah insgesamt			**29.206.946**	**5,54**
	Malaysischer Ringgit				
5.700.000	Malaysia Government Bond**	2,63 %	15.04.2031	1.146.168	0,22
1.750.000	Malaysia Government Bond**	3,58 %	15.07.2032	373.784	0,07
7.600.000	Malaysia Government Bond**	3,73 %	15.06.2028	1.659.177	0,31
3.600.000	Malaysia Government Bond**	3,76 %	22.05.2040	749.897	0,14
4.780.000	Malaysia Government Bond**	3,83 %	05.07.2034	1.033.923	0,20
3.300.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	30.11.2026	726.009	0,14
10.500.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	16.11.2027	2.307.943	0,44
1.800.000	Malaysia Government Bond**	3,91 %	15.07.2026	395.837	0,08
6.565.000	Malaysia Government Bond**	4,07 %	15.06.2050	1.403.184	0,27
2.410.000	Malaysia Government Bond**	4,25 %	31.05.2035	537.737	0,10
2.300.000	Malaysia Government Bond**	4,50 %	30.04.2029	520.568	0,10
6.800.000	Malaysia Government Bond**	4,50 %	15.04.2030	1.543.320	0,29
7.448.000	Malaysia Government Bond**	4,64 %	07.11.2033	1.741.005	0,33
14.051.000	Malaysia Government Bond**	4,70 %	15.10.2042	3.292.745	0,63
2.800.000	Malaysia Government Bond**	4,76 %	07.04.2037	657.305	0,12
9.290.000	Malaysia Government Bond**	4,89 %	08.06.2038	2.220.550	0,42
2.400.000	Malaysia Government Bond**	4,94 %	30.09.2043	570.840	0,11
10.000.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,07 %	30.09.2026	2.204.177	0,42
5.000.000	Malaysia Government Investment Issue**	4,37 %	31.10.2028	1.120.846	0,21
	Malaysischer Ringgit insgesamt			**24.205.015**	**4,60**
	Mexikanischer Peso				
69.430.000	Mexican Bonos*	5,50 %	04.03.2027	3.678.074	0,70
33.480.000	Mexican Bonos*	7,50 %	26.05.2033	1.804.958	0,34

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)				
	Mexikanischer Peso (Fortsetzung)				
99.104.600	Mexican Bonos*	7,75 %	29.05.2031	5.462.004	1,04
54.428.300	Mexican Bonos*	7,75 %	13.11.2042	2.829.648	0,54
4.130.800	Mexican Bonos*	8,00 %	07.11.2047	218.201	0,04
89.439.100	Mexican Bonos*	8,50 %	31.05.2029	5.171.512	0,98
38.862.000	Mexican Bonos*	8,50 %	18.11.2038	2.190.679	0,41
4.890.000	Mexican Bonos*	10,00 %	20.11.2036	311.286	0,06
	Mexikanischer Peso insgesamt			**21.666.362**	**4,11**
	Peruanischer Sol				
12.864.000	Fondo MIVIVIENDA SA*	7,00 %	14.02.2024	3.457.639	0,66
2.110.000	Peru Government Bond*	5,35 %	12.08.2040	488.586	0,09
2.604.000	Peru Government Bond*	5,40 %	12.08.2034	636.089	0,12
9.927.000	Peru Government Bond*	6,15 %	12.08.2032	2.619.737	0,50
3.885.000	Peru Government Bond*	7,30 %	12.08.2033	1.100.721	0,21
3.153.000	Peruvian Government International Bond*	5,40 %	12.08.2034	770.195	0,14
3.429.000	Peruvian Government International Bond**	6,90 %	12.08.2037	934.561	0,18
60.000	Peruvian Government International Bond**	8,20 %	12.08.2026	17.205	0,00
	Peruanischer Sol insgesamt			**10.024.733**	**1,90**
	Philippinischer Peso				
58.120.000	Philippine Government Bond*	6,75 %	15.09.2032	1.105.103	0,21
	Philippinischer Peso insgesamt			**1.105.103**	**0,21**
	Polnischer Zloty				
7.316.000	Republic of Poland Government Bond*	0,25 %	25.10.2026	1.636.001	0,31
8.251.000	Republic of Poland Government Bond**	1,25 %	25.10.2030	1.661.718	0,31
29.163.000	Republic of Poland Government Bond*	1,75 %	25.04.2032	5.771.771	1,09
18.217.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50 %	25.07.2026	4.364.256	0,83
4.556.000	Republic of Poland Government Bond**	2,75 %	25.04.2028	1.063.007	0,20
6.668.000	Republic of Poland Government Bond*	2,75 %	25.10.2029	1.514.830	0,29
9.216.000	Republic of Poland Government Bond*	3,75 %	25.05.2027	2.259.051	0,43
5.192.000	Republic of Poland Government Bond*	6,00 %	25.10.2033	1.401.251	0,27
24.822.000	Republic of Poland Government Bond*	7,50 %	25.07.2028	6.951.105	1,32
	Polnischer Zloty insgesamt			**26.622.990**	**5,05**
	Rumänischer neuer Leu				
12.060.000	Romania Government Bond*	2,50 %	25.10.2027	2.350.285	0,44
3.670.000	Romania Government Bond*	3,65 %	24.09.2031	687.262	0,13
1.085.000	Romania Government Bond*	4,75 %	11.10.2034	212.687	0,04
7.770.000	Romania Government Bond**	4,85 %	25.07.2029	1.620.189	0,31

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)				
	Rumänischer neuer Leu (Fortsetzung)				
1.190.000	Romania Government Bond*	5,00 %	12.02.2029	250.432	0,05
2.735.000	Romania Government Bond*	6,70 %	25.02.2032	626.425	0,12
630.000	Romania Government Bond*	7,35 %	28.04.2031	148.990	0,03
985.000	Romania Government Bond*	7,90 %	24.02.2038	252.981	0,05
1.085.000	Romania Government Bond*	8,00 %	29.04.2030	262.925	0,05
4.215.000	Romania Government Bond*	8,25 %	29.09.2032	1.058.937	0,20
3.525.000	Romania Government Bond*	8,75 %	30.10.2028	863.273	0,16
	Rumänischer neuer Leu insgesamt			**8.334.386**	**1,58**
	Serbischer Dinar				
15.020.000	Serbia Treasury Bonds*	4,50 %	11.01.2026	139.402	0,03
24.630.000	Serbia Treasury Bonds*	4,50 %	20.08.2032	206.255	0,04
46.430.000	Serbia Treasury Bonds*	5,88 %	08.02.2028	444.867	0,08
	Serbischer Dinar insgesamt			**790.524**	**0,15**
	Südafrikanischer Rand				
113.833.220	Republic of South Africa Government Bond*	6,25 %	31.03.2036	4.091.771	0,78
25.675.679	Republic of South Africa Government Bond*	6,50 %	28.02.2041	849.842	0,16
113.551.464	Republic of South Africa Government Bond*	7,00 %	28.02.2031	5.200.548	0,99
132.785.468	Republic of South Africa Government Bond*	8,50 %	31.01.2037	5.689.354	1,08
47.130.129	Republic of South Africa Government Bond*	8,75 %	31.01.2044	1.914.585	0,36
70.099.452	Republic of South Africa Government Bond*	8,75 %	28.02.2048	2.827.744	0,54
62.637.569	Republic of South Africa Government Bond*	9,00 %	31.01.2040	2.685.666	0,51
49.303.416	Republic of South Africa Government Bond*	10,50 %	21.12.2026	2.825.022	0,53
	Südafrikanischer Rand insgesamt			**26.084.532**	**4,95**
	Thailändischer Baht				
150.162.000	Thailand Government Bond**	1,45 %	17.12.2024	4.362.585	0,83
3.425.000	Thailand Government Bond*	1,59 %	17.12.2035	88.836	0,02
17.000.000	Thailand Government Bond**	1,60 %	17.12.2029	472.711	0,09
10.000.000	Thailand Government Bond**	1,60 %	17.06.2035	260.794	0,05
31.800.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.06.2042	795.187	0,15
17.000.000	Thailand Government Bond**	2,40 %	17.03.2029	496.682	0,09
8.831.000	Thailand Government Bond**	2,88 %	17.06.2046	237.296	0,04
53.284.000	Thailand Government Bond**	3,30 %	17.06.2038	1.630.163	0,31
90.384.000	Thailand Government Bond**	3,35 %	17.06.2033	2.791.358	0,53
37.300.000	Thailand Government Bond**	3,39 %	17.06.2037	1.157.719	0,22
55.278.000	Thailand Government Bond**	3,40 %	17.06.2036	1.711.068	0,32
42.200.000	Thailand Government Bond**	3,45 %	17.06.2043	1.297.357	0,25
13.380.000	Thailand Government Bond**	3,78 %	25.06.2032	423.705	0,08

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)				
	Thailändischer Baht (Fortsetzung)				
47.595.000	Thailand Government Bond**	4,88 %	22.06.2029	1.562.276	0,30
	Thailändischer Baht insgesamt			**17.287.737**	**3,28**
	Türkische Lira				
74.210.173	Turkey Government Bond*	1,50 %	18.06.2025	2.640.851	0,50
12.481.091	Turkiye Government Bond*	17,80 %	13.07.2033	331.742	0,06
37.301.788	Turkiye Government Bond*	26,20 %	05.10.2033	1.313.532	0,25
	Türkische Lira insgesamt			**4.286.125**	**0,81**
	Uganda-Schilling				
4.469.700.000	Republic of Uganda Government Bonds*	14,25 %	22.06.2034	1.119.625	0,21
	Uganda-Schilling insgesamt			**1.119.625**	**0,21**
	US-Dollar				
1.431.000	Angolan Government International Bond*	8,75 %	14.04.2032	1.262.460	0,24
310.000	Angolan Government International Bond*	9,13 %	26.11.2049	253.812	0,05
1.877.000	Angolan Government International Bond*	9,38 %	08.05.2048	1.566.878	0,30
3.696.488	Argentine Republic Government International Bond*	0,75 %	09.07.2030	1.491.558	0,28
470.000	Argentine Republic Government International Bond*	1,00 %	09.07.2029	188.940	0,04
7.482.174	Argentine Republic Government International Bond*	3,63 %	09.07.2035	2.585.579	0,49
690.000	Bahamas Government International Bond*	6,00 %	21.11.2028	614.100	0,12
240.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	5,38 %	22.05.2033	243.847	0,05
1.049.000	Bermuda Government International Bond*	5,00 %	15.07.2032	1.043.230	0,20
1.056.000	Brazilian Government International Bond*	5,00 %	27.01.2045	864.826	0,16
290.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	07.01.2041	268.788	0,05
200.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	21.02.2047	176.323	0,03
665.000	Brazilian Government International Bond*	6,00 %	20.10.2033	666.460	0,13
310.000	Brazilian Government International Bond**	6,25 %	18.03.2031	322.121	0,06
200.000	Brazilian Government International Bond*	8,25 %	20.01.2034	235.976	0,04
417.000	Chile Government International Bond*	3,25 %	21.09.2071	281.009	0,05
250.000	Colombia Government International Bond*	3,00 %	30.01.2030	211.605	0,04
950.000	Colombia Government International Bond*	5,00 %	15.06.2045	740.397	0,14
2.403.000	Colombia Government International Bond*	5,20 %	15.05.2049	1.885.074	0,36
635.000	Colombia Government International Bond*	6,13 %	18.01.2041	579.272	0,11
1.010.000	Colombia Government International Bond*	7,50 %	02.02.2034	1.068.607	0,20
625.000	Colombia Government International Bond*	8,00 %	20.04.2033	682.828	0,13
224.000	Colombia Government International Bond**	8,00 %	14.11.2035	245.499	0,05
200.000	Colombia Government International Bond*	8,75 %	14.11.2053	230.451	0,04
561.000	Corp Financiera de Desarrollo SA*	5,25 %	15.07.2029	556.313	0,11
285.000	Costa Rica Government International Bond*	6,55 %	03.04.2034	295.866	0,06
162.000	Costa Rica Government International Bond*	7,16 %	12.03.2045	172.368	0,03

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
786.000	Costa Rica Government International Bond*	7,30 %	13.11.2054	854.775	0,16
2.174.000	Dominican Republic International Bond*	5,88 %	30.01.2060	1.885.934	0,36
795.000	Dominican Republic International Bond*	6,00 %	22.02.2033	786.056	0,15
314.000	Dominican Republic International Bond*	6,40 %	05.06.2049	296.337	0,06
219.000	Dominican Republic International Bond*	6,50 %	15.02.2048	209.419	0,04
187.000	Dominican Republic International Bond*	6,85 %	27.01.2045	186.891	0,04
34.209	Ecuador Government International Bond*	0,00 %	31.07.2030	9.843	0,00
658.547	Ecuador Government International Bond*	2,50 %	31.07.2040	210.735	0,04
4.699.354	Ecuador Government International Bond*	3,50 %	31.07.2035	1.693.350	0,32
611.432	Ecuador Government International Bond*	6,00 %	31.07.2030	285.728	0,05
240.000	Egypt Government International Bond*	8,15 %	20.11.2059	148.151	0,03
2.150.000	Egypt Government International Bond*	8,70 %	01.03.2049	1.352.576	0,26
1.280.000	Egypt Government International Bond*	8,88 %	29.05.2050	819.313	0,16
550.000	El Salvador Government International Bond*	7,65 %	15.06.2035	431.062	0,08
3.219.000	El Salvador Government International Bond*	9,50 %	15.07.2052	2.696.072	0,51
600.000	Ethiopia International Bond*	6,63 %	11.12.2024	407.794	0,08
210.000	Ghana Government International Bond*	7,88 %	26.03.2027	94.355	0,02
494.000	Ghana Government International Bond*	8,63 %	07.04.2034	216.956	0,04
311.000	Ghana Government International Bond*	8,95 %	26.03.2051	135.111	0,03
3.119.000	Ghana Government International Bond*	10,75 %	14.10.2030	1.974.720	0,37
203.000	Guatemala Government Bond*	3,70 %	07.10.2033	169.886	0,03
200.000	Guatemala Government Bond*	6,13 %	01.06.2050	190.000	0,04
1.223.000	Guatemala Government Bond*	6,60 %	13.06.2036	1.262.748	0,24
335.000	Guatemala Government Bond*	7,05 %	04.10.2032	356.817	0,07
551.000	Honduras Government International Bond*	5,63 %	24.06.2030	492.456	0,09
351.000	Honduras Government International Bond*	6,25 %	19.01.2027	337.837	0,06
140.000	Indonesia Government International Bond*	8,50 %	12.10.2035	186.550	0,04
173.813	Iraq International Bond*	5,80 %	15.01.2028	162.944	0,03
360.000	Istanbul Metropolitan Municipality*	10,50 %	06.12.2028	382.950	0,07
200.000	Jordan Government International Bond*	7,38 %	10.10.2047	178.321	0,03
1.235.000	Lebanon Government International Bond*	6,38 %	09.03.2020	75.644	0,01
3.089.000	Lebanon Government International Bond*	6,60 %	27.11.2026	190.011	0,04
878.000	Lebanon Government International Bond*	6,65 %	26.02.2030	55.017	0,01
965.000	Lebanon Government International Bond*	6,85 %	25.05.2029	59.678	0,01
7.131.000	Lebanon Government International Bond*	8,25 %	17.05.2034	444.083	0,08
1.720.000	Mexico Government International Bond*	5,75 %	12.10.2110	1.545.722	0,29
201.000	Mongolia Government International Bond*	3,50 %	07.07.2027	179.863	0,03
200.000	Mongolia Government International Bond*	5,13 %	07.04.2026	194.482	0,04
263.000	Mongolia Government International Bond*	7,88 %	05.06.2029	269.310	0,05
943.000	Mongolia Government International Bond*	8,65 %	19.01.2028	989.497	0,19
411.000	Morocco Government International Bond*	3,00 %	15.12.2032	339.118	0,06

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
400.000	Morocco Government International Bond*	6,50 %	08.09.2033	422.841	0,08
627.000	Nigeria Government International Bond*	7,88 %	16.02.2032	565.397	0,11
421.000	Nigeria Government International Bond*	8,25 %	28.09.2051	346.710	0,07
806.000	Nigeria Government International Bond*	8,75 %	21.01.2031	770.911	0,15
588.000	Nigeria Government International Bond*	9,25 %	21.01.2049	531.187	0,10
1.930.000	Oman Government International Bond*	6,75 %	17.01.2048	2.024.126	0,38
316.000	Oman Government International Bond*	7,00 %	25.01.2051	341.806	0,06
213.000	Panama Government International Bond*	4,30 %	29.04.2053	143.208	0,03
906.000	Panama Government International Bond*	4,50 %	01.04.2056	610.726	0,12
380.000	Panama Government International Bond*	4,50 %	19.01.2063	249.551	0,05
930.000	Panama Government International Bond*	6,40 %	14.02.2035	910.068	0,17
200.000	Panama Government International Bond*	6,85 %	28.03.2054	187.633	0,04
200.000	Panama Government International Bond*	6,88 %	31.01.2036	200.053	0,04
485.000	Papua New Guinea Government International Bond*	8,38 %	04.10.2028	463.902	0,09
448.000	Paraguay Government International Bond*	5,40 %	30.03.2050	399.504	0,08
663.000	Paraguay Government International Bond*	5,60 %	13.03.2048	606.365	0,11
610.000	Provincia de Buenos Aires*	6,38 %	01.09.2037	235.134	0,04
242.114	Provincia de Cordoba*	6,88 %	10.12.2025	220.369	0,04
751.000	Republic of Armenia International Bond*	3,60 %	02.02.2031	615.954	0,12
1.450.000	Republic of Azerbaijan International Bond*	5,13 %	01.09.2029	1.427.279	0,27
497.000	Republic of Poland Government International Bond*	5,50 %	04.04.2053	519.512	0,10
1.846.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,75 %	30.09.2049	1.479.754	0,28
922.000	Republic of South Africa Government International Bond*	7,30 %	20.04.2052	875.813	0,17
250.000	Romanian Government International Bond*	7,63 %	17.01.2053	280.910	0,05
473.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,20 %	11.05.2027	240.191	0,05
2.816.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,75 %	18.04.2028	1.423.652	0,27
1.075.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,83 %	18.07.2026	552.976	0,10
1.196.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	14.03.2024	609.034	0,12
1.913.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	03.11.2025	989.973	0,19
629.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,55 %	28.03.2030	317.564	0,06
524.000	State Agency of Roads of Ukraine*	6,25 %	24.06.2030	135.061	0,03
870.000	Turkiye Government International Bond*	9,13 %	13.07.2030	962.368	0,18
378.000	Turkiye Government International Bond*	9,38 %	14.03.2029	418.945	0,08
217.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	9,38 %	31.01.2026	227.436	0,04
1.782.000	Ukraine Government International Bond*	6,88 %	21.05.2031	415.562	0,08
179.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2027	49.515	0,01
1.921.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.08.2041	866.577	0,16
621.000	Uzbekneftegaz JSC*	4,75 %	16.11.2028	518.800	0,10
7.776.600	Venezuela Government International Bond*	8,25 %	13.10.2024	1.222.673	0,23
660.000	Zambia Government International Bond*	5,38 %	20.09.2022	371.042	0,07

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 62,75 % (31. Dezember 2022: 61,28 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
2.076.000	Zambia Government International Bond*	8,97 %	30.07.2027	1.292.061	0,24
	US-Dollar insgesamt			**66.534.442**	**12,63**
	Uruguayischer Peso				
12.166.818	Uruguay Government International Bond*	8,25 %	21.05.2031	288.962	0,06
93.003.000	Uruguay Government International Bond*	8,50 %	15.03.2028	2.299.743	0,44
8.758.973	Uruguay Government International Bond*	9,75 %	20.07.2033	227.085	0,04
	Uruguayischer Peso insgesamt			**2.815.790**	**0,54**
	Sambischer Kwacha				
68.483.000	Zambia Government Bond*	13,00 %	25.01.2031	1.720.200	0,33
	Sambischer Kwacha insgesamt			**1.720.200**	**0,33**
	Staatsanleihen insgesamt			**330.568.106**	**62,75**

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Investmentfonds 2,72 % (31. Dezember 2022: 2,84 %)		
	US-Dollar		
1.409.964	Neuberger Berman China Bond Fund	14.297.035	2,72
	Investmentfonds insgesamt [µ]	**14.297.035**	**2,72**
	Anlagen insgesamt	**493.949.385**	**93,77**

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 0,86 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
5.403.668 BRL	1.089.467 US$	03.04.2024	Citibank NA	1	13.600	0,00
12.554.008 BRL	2.551.161 US$	20.02.2024	Morgan Stanley	1	22.094	0,00
150.531.314 BRL	30.302.624 US$	03.04.2024	Morgan Stanley	1	425.779	0,08
1.239.369.244 CLP	1.399.879 US$	20.03.2024	Morgan Stanley	1	13.637	0,00
23.159.545 CNY	3.261.278 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	8.689	0,00
5.986.231 CNY	843.389 US$	20.02.2024	Goldman Sachs International	1	118	0,00
23.159.545 CNY	3.261.431 US$	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	8.536	0,00
1.471.347.925 COP	367.926 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	6.011	0,00
81.295.166 EGP	2.368.050 US$	17.01.2024	Citibank NA	1	43.482	0,01
5.594.962 €	137.190.928 CZK	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	74.070	0,01
5.277.364 €	5.761.791 US$	04.01.2024	Barclays Bank Plc	3	68.074	0,01
1.063.835 €	4.630.073 PLN	20.03.2024	Citibank NA	1	2.637	0,00
2.596.222 €	2.843.950 US$	04.01.2024	Citibank NA	2	24.077	0,01
2.420.976 €	2.654.028 US$	04.01.2024	Goldman Sachs International	2	20.406	0,00

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 0,86 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
1.193.794 €	5.199.448 PLN	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	2.004	0,00
2.272.426 €	2.468.332 US$	17.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	43.355	0,01
1.593.159 €	6.930.568 PLN	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	4.776	0,00
845.153 €	925.406 US$	04.01.2024	Morgan Stanley	1	8.228	0,00
169.636.422 HUF	440.014 €	06.02.2024	Goldman Sachs International	1	1.124	0,00
163.043.725 HUF	423.112 €	06.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	861	0,00
9.857.431.615 IDR	629.955 US$	07.02.2024	BNP Paribas	1	9.403	0,00
19.713.013.706 IDR	1.249.280 US$	07.02.2024	Deutsche Bank AG	1	29.316	0,01
1.130.476 ILS	304.876 US$	25.01.2024	Goldman Sachs International	1	9.205	0,00
207.011.159 INR	2.483.134 US$	22.01.2024	Citibank NA	1	2.297	0,00
106.212.688 INR	1.273.196 US$	08.02.2024	Standard Chartered Bank	1	1.130	0,00
1.684.447.172 KRW	1.298.455 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	6.529	0,00
1.707.662.945 KRW	1.295.841 US$	16.01.2024	Morgan Stanley	1	21.653	0,00
3.302.310.926 KRW	2.509.774 US$	22.01.2024	Standard Chartered Bank	1	39.211	0,01
1.706.928.097 KRW	1.315.012 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	7.388	0,00
94.214.997 MXN	5.349.038 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	144.583	0,03
5.649.036 MXN	326.365 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	3.027	0,00
14.863.927 MXN	840.786 US$	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	25.920	0,01
44.347.597 MXN	2.539.627 US$	20.02.2024	Standard Chartered Bank	1	57.987	0,01
5.758.963 MYR	1.218.441 US$	23.01.2024	HSBC Bank Plc	1	38.910	0,01
14.883.772 MYR	3.208.747 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	54.964	0,01
6.062.404 MYR	1.298.771 US$	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	23.640	0,01
12.644.946 MYR	2.727.265 US$	07.03.2024	Standard Chartered Bank	1	43.278	0,01
9.433.937 PEN	2.467.227 US$	18.01.2024	Barclays Bank Plc	1	79.454	0,02
70.120.397 PHP	1.251.426 US$	06.02.2024	HSBC Bank Plc	1	14.415	0,00
3.150.745 RON	631.523 €	19.01.2024	Citibank NA	1	1.399	0,00
4.072.805 RON	816.523 €	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.603	0,00
1.658.544 SGD	1.219.383 US$	22.01.2024	Morgan Stanley	1	39.121	0,01
43.788.780 THB	1.258.501 US$	22.01.2024	Citibank NA	1	26.687	0,01
184.243.696 THB	5.293.968 US$	20.03.2024	Goldman Sachs International	3	140.255	0,03
100.121.321 THB	2.875.769 US$	20.03.2024	Standard Chartered Bank	1	77.285	0,02
46.397.101 THB	1.298.620 US$	16.01.2024	Standard Chartered Bank	1	62.290	0,01
91.089.188 THB	2.596.865 US$	08.01.2024	Standard Chartered Bank	1	72.890	0,01
81.585.541 TWD	2.564.373 US$	12.01.2024	HSBC Bank Plc	1	112.587	0,02
41.130.425 TWD	1.312.939 US$	08.01.2024	Standard Chartered Bank	1	33.591	0,01
17.547.195 US$	15.859.544 €	02.02.2024	Citibank NA	2	5.372	0,00
1.525.721 US$	28.016.034 ZAR	20.03.2024	Citibank NA	1	4.119	0,00
890.685 US$	49.233.512 PHP	20.03.2024	Citibank NA	1	1.933	0,00
97.152 US$	124.294.446 KRW	20.03.2024	Citibank NA	1	858	0,00
1.328.262 US$	1.719.939.972 KRW	16.01.2024	HSBC Bank Plc	1	1.296	0,00

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 0,86 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
1.242.320 US$	1.608.617.394 KRW	22.01.2024	Morgan Stanley	1	662	0,00
52.176.725 UYU	1.302.790 US$	27.03.2024	Citibank NA	1	22.839	0,00
37.479.491 UYU	934.746 US$	09.02.2024	Citibank NA	2	22.707	0,00
8.828.681 UYU	217.992 US$	09.02.2024	Goldman Sachs International	1	7.546	0,00
35.527.584 UYU	878.007 US$	09.02.2024	JPMorgan Chase Bank	2	29.582	0,01
26.353.226 ZAR	1.385.169 US$	20.03.2024	Morgan Stanley	1	46.123	0,01
45.917.508 ZAR	2.485.790 US$	22.01.2024	Morgan Stanley	1	20.776	0,00
5.381.279 ZAR	291.200 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	1.067	0,00
Abgesicherte Klassen AUD						
4.028.207 AUD	2.659.930 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	3	94.705	0,02
Abgesicherte Klassen EUR						
176.462.740 €	191.291.954 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	4	4.199.321	0,81
4.230.001 €	4.663.789 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	8	22.347	0,00
49.928 US$	44.832 €	14.03.2024	Westpac Banking Corp	4	263	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
6.633.345 £	8.366.366 US$	14.03.2024	UBS AG	3	92.872	0,02
188.091 £	238.067 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	12	1.796	0,00
231 US$	181 £	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	0	0,00
Abgesicherte Klassen NOK						
130.008 NOK	11.911 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	912	0,00
Abgesicherte Klassen SEK						
155.502 SEK	14.911 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	562	0,00
17.565.158 SEK	1.682.959 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	3	64.917	0,01
Abgesicherte Klassen SGD						
2.087.683 SGD	1.564.098 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	3	23.792	0,00
268 SGD	200 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	3	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**6.637.946**	**1,26**

Futures-Kontrakte 0,23 % (31. Dezember 2022: 0,25 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
70	Euro-BOBL Future March 2024	215.631	0,04
10	South Korea 10-Year Bond Future March 2024	11.880	0,00
118	South Korea 3-Year Bond Future March 2024	29.319	0,01
74	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	272.711	0,05
20	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024	45.156	0,01
57	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	105.070	0,02
35	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024	285.031	0,05
19	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	234.563	0,05
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**1.199.361**	**0,23**

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte 0,50 % (31. Dezember 2022: 1,03 %)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)[#]	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
CLP	3.154.502.226	05.06.2030	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	2,33 %	1D CLICP	485.600	0,09
MXN	96.923.155	31.08.2029	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	6,92 %	28D MXIBTIIE	405.436	0,08
BRL	17.142.169	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	12,76 %	1D BROIS	340.580	0,07
BRL	13.941.828	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	12,67 %	1D BROIS	266.352	0,05
BRL	9.439.141	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	12,68 %	1D BROIS	181.570	0,04
MXN	63.783.049	01.01.2032	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	7,64 %	28D MXIBTIIE	175.540	0,03
BRL	34.632.671	02.01.2026	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	11,57 %	1D BROIS	146.066	0,03
BRL	16.274.019	02.01.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	11,06 %	1D BROIS	87.788	0,02
BRL	3.909.270	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	13,02 %	1D BROIS	86.349	0,02
COP	14.710.158.205	31.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	7,14 %	1D COOVIBR	73.097	0,01
BRL	19.663.289	02.01.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	10,59 %	1D BROIS	70.488	0,01
COP	20.252.351.381	13.04.2024	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	8,37 %	1D COOVIBR	54.031	0,01
MXN	29.184.713	30.10.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	9,26 %	28D MXIBTIIE	46.197	0,01
BRL	6.581.593	02.01.2031	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	10,49 %	1D BROIS	38.305	0,01
COP	3.561.060.874	06.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	6,40 %	1D COOVIBR	35.890	0,01
BRL	8.615.804	02.01.2031	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	10,43 %	1D BROIS	25.248	0,01
CZK	245.067.618	22.12.2025	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,47 %	6M PRIBOR	21.157	0,00
MXN	27.580.600	17.08.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	8,94 %	28D MXIBTIIE	20.053	0,00
MXN	27.580.600	17.08.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	8,91 %	28D MXIBTIIE	18.190	0,00
COP	1.516.059.531	07.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	6,45 %	1D COOVIBR	14.717	0,00
BRL	8.384.051	04.01.2027	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	10,17 %	1D BROIS	13.396	0,00
MXN	37.047.081	20.03.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	10,05 %	28D MXIBTIIE	12.470	0,00
CZK	10.317.097	25.07.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,19 %	6M PRIBOR	11.411	0,00
CNY	20.200.000	29.08.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,30 %	7D CNRR	7.118	0,00
CZK	1.248.614	16.10.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,30 %	6M PRIBOR	1.715	0,00
CNY	16.400.000	11.12.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,25 %	7D CNRR	1.670	0,00
CNY	19.000.000	16.08.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,28 %	7D CNRR	777	0,00
MYR	16.534.909	20.12.2025	Goldman Sachs International	(Zahlung)	3,50 %	3M KLIBOR	701	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten [∞]							**2.641.912**	**0,50**

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

[1]Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**504.428.604**	**95,76**

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,39 %) (31. Dezember 2022: (0,44 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
2.083.051.058 CLP	2.377.288 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	(1.541)	(0,00)
1.905.868 CNY	268.688 US$	20.02.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(136)	(0,00)
18.955.714 CNY	2.664.067 US$	10.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(588)	(0,00)
49.202.797 EGP	1.120.793 US$	02.04.2024	Citibank NA	1	(6.347)	(0,00)
8.682.847 EGP	199.148 US$	02.04.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(2.481)	(0,00)
15.859.544 €	17.526.540 US$	03.01.2024	Citibank NA	2	(7.293)	(0,00)
75.975 €	378.948 RON	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(146)	(0,00)
920.404.140 HUF	2.401.910 €	06.02.2024	Goldman Sachs International	1	(9.946)	(0,00)
1.608.617.394 KRW	1.248.878 US$	22.01.2024	Citibank NA	1	(7.220)	(0,00)
5.377.524 PLN	1.233.769 €	20.03.2024	Citibank NA	1	(1.063)	(0,00)
2.133.212 PLN	489.973 €	20.03.2024	Goldman Sachs International	1	(1.030)	(0,00)
1.265.959 RON	254.293 €	19.01.2024	Goldman Sachs International	1	(44)	(0,00)
23.090 US$	163.971 CNY	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	(62)	(0,00)
5.024.108 US$	4.591.636 €	05.02.2024	Barclays Bank Plc	1	(55.146)	(0,01)
3.018.592 US$	2.783.875 €	04.01.2024	Barclays Bank Plc	3	(56.734)	(0,01)
122.842 US$	4.252.407 THB	20.03.2024	BNP Paribas	1	(2.582)	(0,00)
1.021.692 US$	930.000 €	03.01.2024	Brown Brothers Harriman	1	(5.632)	(0,00)
4.086.435 US$	15.703.354 PEN	18.01.2024	Citibank NA	1	(152.669)	(0,03)
536.520 US$	9.441.073 MXN	20.03.2024	Citibank NA	1	(13.983)	(0,00)
1.202.152 US$	1.638.347 SGD	22.01.2024	Citibank NA	1	(41.027)	(0,01)
1.340.045 US$	46.702.839 THB	16.01.2024	Citibank NA	1	(29.833)	(0,01)
2.181.734 US$	15.920.947 CNY	10.01.2024	Citibank NA	1	(55.328)	(0,01)
2.492.297 US$	2.272.426 €	17.01.2024	Citibank NA	1	(19.390)	(0,00)
3.258.338 US$	2.967.502 €	05.02.2024	Citibank NA	2	(24.305)	(0,01)
2.022.974 US$	72.612.319 EGP	17.01.2024	Citibank NA	2	(130.991)	(0,03)
76.618 US$	100.020.484 KRW	20.03.2024	Citibank NA	1	(870)	(0,00)
9.733.566 US$	39.674.988.141 COP	20.03.2024	Goldman Sachs International	1	(349.685)	(0,07)
5.290.833 US$	21.455.334.544 COP	01.02.2024	Goldman Sachs International	1	(211.778)	(0,04)
478.589 US$	8.285.760 MXN	20.03.2024	Goldman Sachs International	1	(4.549)	(0,00)
1.248.184 US$	43.788.780 THB	22.01.2024	Goldman Sachs International	1	(37.004)	(0,01)
482.539 US$	440.778 €	03.01.2024	Goldman Sachs International	1	(4.366)	(0,00)
3.090.560 US$	2.858.636 €	04.01.2024	Goldman Sachs International	2	(67.355)	(0,01)
398.680 US$	1.849.318 MYR	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	(6.838)	(0,00)
144.506 US$	188.623.490 KRW	20.03.2024	HSBC Bank Plc	2	(1.625)	(0,00)
654.069 US$	3.265.313 BRL	03.04.2024	HSBC Bank Plc	1	(12.489)	(0,00)
23.091 US$	163.971 CNY	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	(60)	(0,00)
1.065.056 US$	16.516.241.760 IDR	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	(5.958)	(0,00)
2.049.814 US$	83.437.674 UYU	09.02.2024	HSBC Bank Plc	1	(81.689)	(0,02)
248.081 US$	8.682.847 EGP	17.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(9.486)	(0,00)
1.188.899 US$	5.631.814 MYR	23.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(40.692)	(0,01)
527.669 US$	2.445.483 MYR	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(8.576)	(0,00)

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,39 %) (31. Dezember 2022: (0,44 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
268.900 US$	4.174.945.833 IDR	07.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.889)	(0,00)
2.860.957 US$	53.668.021 ZAR	20.03.2024	Morgan Stanley	2	(53.852)	(0,01)
6.012.522 US$	5.497.203 €	04.01.2024	Morgan Stanley	3	(60.199)	(0,01)
2.245.001 US$	8.406.405 PEN	18.01.2024	Morgan Stanley	1	(24.300)	(0,01)
1.319.202 US$	40.914.125 TWD	08.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(20.247)	(0,00)
10.590.995 US$	75.692.969 CNY	20.02.2024	Standard Chartered Bank	2	(74.745)	(0,01)
15.858.684 US$	14.488.766 €	03.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(146.333)	(0,03)
340.835 US$	2.417.057 CNY	20.03.2024	Standard Chartered Bank	1	(436)	(0,00)
2.198.333 US$	34.404.574.910 IDR	20.03.2024	Standard Chartered Bank	1	(32.668)	(0,01)
2.552.974 US$	81.697.729 TWD	12.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(127.667)	(0,02)
Abgesicherte Klassen EUR						
3.408.905 US$	3.119.584 €	14.03.2024	Westpac Banking Corp	21	(47.073)	(0,01)
Abgesicherte Klassen GBP						
78.786 £	100.595 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	3	(122)	(0,00)
107.947 US$	85.532 £	14.03.2024	Westpac Banking Corp	12	(1.128)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SEK						
931 SEK	94 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	(1)	(0,00)
426.246 US$	4.444.614 SEK	14.03.2024	Westpac Banking Corp	14	(16.029)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(2.075.226)**	**(0,39)**

Futures-Kontrakte (0,19 %) (31. Dezember 2022: (0,03 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
(75)	Euro-Bund Future March 2024	(267.480)	(0,05)
(23)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024	(216.865)	(0,04)
(3)	Euro-Schatz Future March 2024	(1.508)	(0,00)
(31)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	(127.391)	(0,03)
(20)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024	(200.937)	(0,04)
(12)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	(155.344)	(0,03)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(969.525)**	**(0,19)**

Zinsswap-Kontrakte (1,10 %) (31. Dezember 2022: (2,46 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
INR	259.567.091	19.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	6,21 %	1D MIBOR	(86)	(0,00)
CLP	1.516.255.404	24.10.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	6,12 %	1D CLICP	(188)	(0,00)

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte (1,10 %) (31. Dezember 2022: (2,46 %)) (Fortsetzung)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)[#]	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
COP	2.600.024.896	02.06.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	10,28 %	1D COOVIBR	(7.619)	(0,00)
PLN	6.696.569	07.11.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,51 %	6M WIBOR	(7.720)	(0,00)
BRL	5.917.558	02.01.2029	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	10,30 %	1D BROIS	(11.042)	(0,00)
BRL	26.290.456	02.01.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	10,00 %	1D BROIS	(14.260)	(0,00)
MXN	54.330.570	03.02.2028	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	8,58 %	28D MXIBTIIE	(15.188)	(0,00)
PLN	4.719.181	10.10.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,76 %	6M WIBOR	(17.693)	(0,00)
PLN	6.556.235	01.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,72 %	6M WIBOR	(21.471)	(0,00)
PLN	1.621.573	15.05.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	5,20 %	6M WIBOR	(22.577)	(0,00)
PLN	1.621.573	15.05.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	5,22 %	6M WIBOR	(23.121)	(0,01)
PLN	3.422.027	02.10.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,99 %	6M WIBOR	(34.484)	(0,01)
MXN	9.645.130	08.12.2025	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,21 %	28D MXIBTIIE	(35.993)	(0,01)
MXN	63.984.030	27.05.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	8,58 %	28D MXIBTIIE	(38.024)	(0,01)
MXN	28.121.151	07.01.2028	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	8,04 %	28D MXIBTIIE	(39.125)	(0,01)
PLN	4.495.017	03.10.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	5,01 %	6M WIBOR	(47.109)	(0,01)
COP	20.939.092.335	05.06.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	10,27 %	1D COOVIBR	(61.519)	(0,01)
CLP	2.479.849.388	14.09.2024	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	9,80 %	1D CLICP	(61.535)	(0,01)
CLP	2.698.258.379	13.04.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	7,51 %	1D CLICP	(66.958)	(0,01)
COP	3.223.342.325	11.08.2032	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	9,02 %	1D COOVIBR	(72.298)	(0,01)
BRL	3.954.742	02.01.2031	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	11,45 %	1D BROIS	(80.002)	(0,02)
PLN	2.553.479	30.09.2032	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	6,86 %	6M WIBOR	(110.462)	(0,02)
BRL	5.332.502	02.01.2031	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	11,54 %	1D BROIS	(115.588)	(0,02)
CLP	1.254.313.506	23.01.2030	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	3,06 %	1D CLICP	(127.014)	(0,02)
MXN	37.080.494	05.03.2026	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,17 %	28D MXIBTIIE	(147.727)	(0,03)
MXN	29.276.180	08.10.2038	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	9,77 %	28D MXIBTIIE	(185.524)	(0,04)
MXN	47.500.000	18.06.2026	JPMorgan Chase Bank	(Zahlung)	6,13 %	28D MXIBTIIE	(201.227)	(0,04)
CLP	3.115.406.937	23.06.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	1,16 %	1D CLICP	(223.034)	(0,04)
CLP	3.388.538.669	17.06.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	1,36 %	1D CLICP	(229.934)	(0,04)
CLP	1.377.149.008	24.08.2030	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	2,15 %	1D CLICP	(235.992)	(0,05)
MXN	60.000.000	16.09.2026	Goldman Sachs International	(Zahlung)	6,38 %	28D MXIBTIIE	(242.882)	(0,05)
BRL	29.000.000	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	7,67 %	1D BROIS	(960.482)	(0,18)
BRL	68.736.587	02.01.2024	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	4,84 %	1D BROIS	(2.347.047)	(0,45)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten [∞]							**(5.804.925)**	**(1,10)**

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

[1]Zentral abgewickelter Swap.

Emerging Market Debt Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(8.849.676)**	**(1,68)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**495.578.928**	**94,08**
Sonstiges Nettovermögen	**31.208.879**	**5,92**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**526.787.807**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	362.702.107	67,41
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	116.950.243	21,74
µ	Investmentfonds	14.297.035	2,66
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	229.836	0,04
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	1.399.707	0,26
Anlagen insgesamt		**495.578.928**	**92,11**

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Schatzwechsel 1,26 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
	Thailändischer Baht				
1.300.000	Bank of Thailand Bill	0,00 %	09.05.2024	37.793	0,06
	Thailändischer Baht insgesamt			**37.793**	**0,06**
	US-Dollar				
785.200	United States Treasury Bill	0,00 %	18.01.2024	783.358	1,20
	US-Dollar insgesamt			**783.358**	**1,20**
	Schatzwechsel insgesamt **			**821.151**	**1,26**
	Unternehmensanleihen 14,20 % (31. Dezember 2022: 13,84 %)				
	Kolumbianischer Peso				
73.000.000	Asian Development Bank*	11,20 %	31.01.2025	18.679	0,03
191.000.000	Asian Development Bank*	12,75 %	03.03.2025	49.959	0,08
205.000.000	Asian Development Bank*	13,00 %	07.03.2025	53.399	0,08
270.000.000	International Finance Corp*	0,00 %	16.08.2028	45.178	0,07
	Kolumbianischer Peso insgesamt			**167.215**	**0,26**
	Euro				
100.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	2,75 %	22.01.2033	85.072	0,13
	Euro insgesamt			**85.072**	**0,13**
	Mexikanischer Peso				
3.000.000	Asian Infrastructure Investment Bank*	0,00 %	08.02.2038	48.823	0,08
	Mexikanischer Peso insgesamt			**48.823**	**0,08**
	US-Dollar				
200.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	3,50 %	31.03.2027	190.572	0,29
200.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60 %	02.11.2047	184.066	0,28
200.000	African Export-Import Bank*	2,63 %	17.05.2026	184.960	0,28
200.000	African Export-Import Bank*	3,80 %	17.05.2031	170.093	0,26
200.000	African Export-Import Bank*	3,99 %	21.09.2029	179.302	0,28
200.000	Banco de Credito e Inversiones SA*	3,50 %	12.10.2027	189.313	0,29
200.000	Bank Leumi Le-Israel BM**	3,28 %	29.01.2031	181.290	0,28
200.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT**	4,75 %	13.05.2025	198.753	0,31
880.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	4,70 %	22.10.2031	752.039	1,16
205.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	5,00 %	27.07.2027	191.393	0,29
200.000	Cencosud SA*	4,38 %	17.07.2027	193.093	0,30
300.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,15 %	14.01.2030	268.314	0,41
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,70 %	30.01.2050	144.757	0,22
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	5,95 %	08.01.2034	203.274	0,31

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 14,20 % (31. Dezember 2022: 13,84 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
200.000	DIB Sukuk Ltd*	4,80 %	16.08.2028	198.604	0,31
200.000	DP World Ltd*	6,85 %	02.07.2037	221.251	0,34
240.000	Emirates NBD Bank PJSC*	5,88 %	11.10.2028	248.410	0,38
436.000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado*	3,83 %	14.09.2061	299.936	0,46
200.000	Empresa de Transmision Electrica SA*	5,13 %	02.05.2049	145.369	0,22
200.000	ENN Energy Holdings Ltd**	2,63 %	17.09.2030	171.295	0,26
203.000	First Abu Dhabi Bank PJSC*	5,13 %	13.10.2027	204.766	0,31
200.000	Gabon Blue Bond Master Trust Series 2†	6,10 %	01.08.2038	196.788	0,30
400.000	LG Chem Ltd*	2,38 %	07.07.2031	331.641	0,51
250.000	Malaysia Wakala Sukuk Bhd*	3,08 %	28.04.2051	192.017	0,29
200.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	2,50 %	03.06.2031	173.932	0,27
200.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	3,38 %	28.03.2032	183.250	0,28
200.000	MTR Corp Ltd**	1,63 %	19.08.2030	167.141	0,26
292.000	NBK SPC Ltd*	1,63 %	15.09.2027	264.798	0,41
200.000	NBK Tier 1 Ltd*	3,63 %	29.12.2049	180.710	0,28
200.000	Ooredoo International Finance Ltd*	2,63 %	08.04.2031	174.739	0,27
400.000	Shinhan Bank Co Ltd*	4,00 %	23.04.2029	373.756	0,57
200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd*	3,34 %	05.02.2030	194.910	0,30
200.000	Sigma Alimentos SA de CV*	4,13 %	02.05.2026	195.115	0,30
200.000	Sigma Finance Netherlands BV*	4,88 %	27.03.2028	196.535	0,30
200.000	SK Hynix Inc*	6,50 %	17.01.2033	211.311	0,33
1.000.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24 %	03.06.2050	667.707	1,03
220.000	TSMC Arizona Corp*	3,25 %	25.10.2051	174.453	0,27
400.000	UltraTech Cement Ltd*	2,80 %	16.02.2031	338.843	0,52
	US-Dollar insgesamt			**8.938.496**	**13,73**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**9.239.606**	**14,20**
	Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %)				
	Chilenischer Peso				
91.994.100	Bonos de la Tesoreria de la Republica*	1,90 %	01.09.2030	103.546	0,16
55.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	2,80 %	01.10.2033	51.578	0,08
40.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	4,50 %	01.03.2026	45.706	0,07
25.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	4,70 %	01.09.2030	28.051	0,04
35.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	5,00 %	01.03.2035	40.076	0,06
45.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	6,00 %	01.04.2033	55.020	0,09
20.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	6,00 %	01.01.2043	25.592	0,04
15.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos*	7,00 %	01.05.2034	19.696	0,03
	Chilenischer Peso insgesamt			**369.265**	**0,57**

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)				
	Kolumbianischer Peso				
773.800.000	Colombian TES*	5,75 %	03.11.2027	177.071	0,27
1.201.800.000	Colombian TES*	6,00 %	28.04.2028	273.864	0,42
1.001.800.000	Colombian TES*	7,00 %	26.03.2031	223.232	0,34
1.452.700.000	Colombian TES*	7,00 %	30.06.2032	314.483	0,49
335.400.000	Colombian TES*	7,25 %	18.10.2034	71.331	0,11
1.209.700.000	Colombian TES*	7,75 %	18.09.2030	284.813	0,44
32.300.000	Colombian TES*	9,25 %	28.05.2042	7.571	0,01
849.700.000	Colombian TES*	13,25 %	09.02.2033	260.509	0,40
	Kolumbianischer Peso insgesamt			**1.612.874**	**2,48**
	Tschechische Krone				
2.810.000	Czech Republic Government Bond*	0,05 %	29.11.2029	101.722	0,16
4.070.000	Czech Republic Government Bond*	0,25 %	10.02.2027	162.883	0,25
3.080.000	Czech Republic Government Bond*	0,95 %	15.05.2030	116.624	0,18
9.220.000	Czech Republic Government Bond*	1,20 %	13.03.2031	348.223	0,54
680.000	Czech Republic Government Bond*	1,50 %	24.04.2040	21.906	0,03
1.730.000	Czech Republic Government Bond*	1,75 %	23.06.2032	66.724	0,10
1.870.000	Czech Republic Government Bond*	1,95 %	30.07.2037	67.464	0,10
3.410.000	Czech Republic Government Bond*	2,00 %	13.10.2033	131.363	0,20
270.000	Czech Republic Government Bond*	2,50 %	25.08.2028	11.470	0,02
720.000	Czech Republic Government Bond*	4,20 %	04.12.2036	33.567	0,05
490.000	Czech Republic Government Bond*	5,00 %	30.09.2030	23.599	0,04
590.000	Czech Republic Government Bond*	5,50 %	12.12.2028	28.651	0,04
130.000	Czech Republic Government Bond*	6,20 %	16.06.2031	6.784	0,01
	Tschechische Krone insgesamt			**1.120.980**	**1,72**
	Euro				
410.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	5,13 %	22.02.2033	493.509	0,76
200.000	Bulgaria Government International Bond*	4,13 %	23.09.2029	227.850	0,35
233.000	Bulgaria Government International Bond*	4,38 %	13.05.2031	270.833	0,42
180.000	Bulgaria Government International Bond*	4,50 %	27.01.2033	209.286	0,32
750.000	Chile Government International Bond*	0,83 %	02.07.2031	687.119	1,06
648.092	Chile Government International Bond*	4,13 %	05.07.2034	732.846	1,13
453.000	Hungary Government International Bond*	1,63 %	28.04.2032	407.920	0,63
750.000	Indonesia Government International Bond*	0,90 %	14.02.2027	762.132	1,17
400.000	Indonesia Government International Bond*	1,10 %	12.03.2033	350.705	0,54
2.210.000	Indonesia Government International Bond*	1,40 %	30.10.2031	2.075.878	3,19
400.000	Kazakhstan Government International Bond*	0,60 %	30.09.2026	412.752	0,63
1.000.000	Kazakhstan Government International Bond*	1,50 %	30.09.2034	885.582	1,36

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
940.000	Kazakhstan Government International Bond*	2,38 %	09.11.2028	1.002.137	1,54
350.000	Latvia Government International Bond*	0,25 %	23.01.2030	325.305	0,50
250.000	Lithuania Government International Bond*	2,13 %	01.06.2032	254.284	0,39
298.000	Peruvian Government International Bond*	1,25 %	11.03.2033	259.199	0,40
200.000	Peruvian Government International Bond*	1,95 %	17.11.2036	167.135	0,26
1.000.000	Philippine Government International Bond*	0,70 %	03.02.2029	967.668	1,49
200.000	Philippine Government International Bond*	1,20 %	28.04.2033	177.899	0,27
1.050.000	Philippine Government International Bond*	1,75 %	28.04.2041	813.733	1,25
276.000	Republic of Poland Government International Bond*	4,25 %	14.02.2043	322.320	0,49
437.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	14.04.2033	362.660	0,56
37.000	Romanian Government International Bond*	2,88 %	13.04.2042	27.745	0,04
400.000	Romanian Government International Bond**	3,38 %	08.02.2038	346.934	0,53
1.825.000	Romanian Government International Bond*	3,75 %	07.02.2034	1.743.252	2,68
633.000	Romanian Government International Bond*	3,88 %	29.10.2035	598.099	0,92
247.000	Romanian Government International Bond*	6,38 %	18.09.2033	289.087	0,44
	Euro insgesamt			**15.173.869**	**23,32**
	Ungarischer Forint				
31.830.000	Hungary Government Bond*	3,00 %	27.10.2027	83.867	0,13
12.750.000	Hungary Government Bond*	3,00 %	21.08.2030	31.615	0,05
12.620.000	Hungary Government Bond*	3,25 %	22.10.2031	31.016	0,05
99.900.000	Hungary Government Bond*	4,50 %	23.03.2028	275.272	0,42
47.650.000	Hungary Government Bond*	4,75 %	24.11.2032	127.058	0,19
27.140.000	Hungary Government Bond*	5,50 %	24.06.2025	77.573	0,12
17.610.000	Hungary Government Bond*	6,75 %	22.10.2028	52.850	0,08
35.350.000	Hungary Government Bond*	9,50 %	21.10.2026	110.745	0,17
	Ungarischer Forint insgesamt			**789.996**	**1,21**
	Indonesische Rupiah				
4.000.000.000	Indonesia Treasury Bond*	5,13 %	15.04.2027	250.408	0,38
1.050.000.000	Indonesia Treasury Bond*	5,50 %	15.04.2026	66.919	0,10
300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,25 %	15.06.2036	18.950	0,03
7.512.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.08.2028	487.348	0,75
2.700.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.04.2032	172.968	0,27
300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.07.2037	19.244	0,03
5.406.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,50 %	15.02.2031	349.685	0,54
186.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63 %	15.05.2033	12.123	0,02
2.880.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63 %	15.02.2034	187.209	0,29
5.700.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,88 %	15.04.2029	376.165	0,58

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)				
	Indonesische Rupie (Fortsetzung)				
300.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.05.2027	19.818	0,03
8.726.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.02.2033	587.825	0,90
3.670.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2038	249.815	0,38
1.109.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2042	74.963	0,12
1.753.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,13 %	15.06.2043	118.391	0,18
3.550.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.06.2035	244.321	0,38
1.791.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,50 %	15.04.2040	124.253	0,19
222.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2036	16.213	0,02
100.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.03.2034	7.264	0,01
131.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,38 %	15.04.2039	9.755	0,01
	Indonesische Rupiah insgesamt			**3.393.637**	**5,21**
	Malaysischer Ringgit				
645.000	Malaysia Government Bond**	2,63 %	15.04.2031	129.698	0,20
710.000	Malaysia Government Bond**	3,50 %	31.05.2027	154.078	0,24
570.000	Malaysia Government Bond**	3,58 %	15.07.2032	121.747	0,19
690.000	Malaysia Government Bond**	3,73 %	15.06.2028	150.636	0,23
923.000	Malaysia Government Bond**	3,76 %	22.05.2040	192.265	0,30
265.000	Malaysia Government Bond**	3,83 %	05.07.2034	57.320	0,09
1.550.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	16.11.2027	340.696	0,52
70.000	Malaysia Government Bond**	3,90 %	30.11.2026	15.400	0,02
70.000	Malaysia Government Bond**	3,91 %	15.07.2026	15.394	0,02
400.000	Malaysia Government Bond**	4,07 %	15.06.2050	85.495	0,13
350.000	Malaysia Government Bond**	4,25 %	31.05.2035	78.095	0,12
700.000	Malaysia Government Bond**	4,50 %	15.04.2030	158.871	0,24
850.000	Malaysia Government Bond**	4,50 %	30.04.2029	192.384	0,30
516.000	Malaysia Government Bond**	4,64 %	07.11.2033	120.617	0,18
1.356.000	Malaysia Government Bond**	4,70 %	15.10.2042	317.768	0,49
520.000	Malaysia Government Bond**	4,76 %	07.04.2037	122.071	0,19
513.000	Malaysia Government Bond**	4,89 %	08.06.2038	122.620	0,19
	Malaysischer Ringgit insgesamt			**2.375.155**	**3,65**
	Mexikanischer Peso				
1.760.000	Mexican Bonos*	5,50 %	04.03.2027	93.237	0,15
11.896.000	Mexican Bonos*	7,50 %	03.06.2027	665.760	1,02
3.850.000	Mexican Bonos*	7,50 %	26.05.2033	207.559	0,32
20.465.900	Mexican Bonos*	7,75 %	29.05.2031	1.127.948	1,74
5.919.800	Mexican Bonos*	7,75 %	13.11.2042	307.762	0,47

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)				
	Mexikanischer Peso (Fortsetzung)				
1.503.800	Mexican Bonos*	8,00 %	07.11.2047	79.435	0,12
12.734.000	Mexican Bonos*	8,50 %	31.05.2029	736.300	1,13
	Mexikanischer Peso insgesamt			**3.218.001**	**4,95**
	Peruanischer Sol				
199.000	Peru Government Bond*	5,35 %	12.08.2040	46.080	0,07
86.000	Peru Government Bond*	5,40 %	12.08.2034	21.008	0,03
843.000	Peru Government Bond*	6,15 %	12.08.2032	222.468	0,34
253.000	Peru Government Bond*	7,30 %	12.08.2033	71.681	0,11
56.000	Peruvian Government International Bond*	5,40 %	12.08.2034	13.679	0,02
724.000	Peruvian Government International Bond**	6,90 %	12.08.2037	197.324	0,31
	Peruanischer Sol insgesamt			**572.240**	**0,88**
	Philippinischer Peso				
4.560.000	Philippine Government Bond*	6,75 %	15.09.2032	86.705	0,13
	Philippinischer Peso insgesamt			**86.705**	**0,13**
	Polnischer Zloty				
95.000	Republic of Poland Government Bond*	0,25 %	25.10.2026	21.244	0,03
807.000	Republic of Poland Government Bond**	1,25 %	25.10.2030	162.527	0,25
2.507.000	Republic of Poland Government Bond*	1,75 %	25.04.2032	496.171	0,76
414.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50 %	25.07.2026	99.182	0,15
313.000	Republic of Poland Government Bond*	2,50 %	25.07.2027	73.601	0,11
1.020.000	Republic of Poland Government Bond*	2,75 %	25.10.2029	231.723	0,36
143.000	Republic of Poland Government Bond**	3,25 %	25.07.2025	35.408	0,06
492.000	Republic of Poland Government Bond*	3,75 %	25.05.2027	120.600	0,19
482.000	Republic of Poland Government Bond*	6,00 %	25.10.2033	130.085	0,20
1.812.000	Republic of Poland Government Bond*	7,50 %	25.07.2028	507.429	0,78
	Polnischer Zloty insgesamt			**1.877.970**	**2,89**
	Rumänischer neuer Leu				
1.380.000	Romania Government Bond*	2,50 %	25.10.2027	268.938	0,41
255.000	Romania Government Bond*	3,25 %	24.06.2026	53.161	0,08
1.175.000	Romania Government Bond**	4,85 %	25.07.2029	245.009	0,38
5.000	Romania Government Bond*	5,00 %	12.02.2029	1.052	0,00
540.000	Romania Government Bond*	6,70 %	25.02.2032	123.682	0,19
35.000	Romania Government Bond*	7,35 %	28.04.2031	8.277	0,01
200.000	Romania Government Bond*	8,25 %	29.09.2032	50.246	0,08

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)				
	Rumänischer neuer Leu (Fortsetzung)				
290.000	Romania Government Bond*	8,75 %	30.10.2028	71.021	0,11
	Rumänischer neuer Leu insgesamt			**821.386**	**1,26**
	Thailändischer Baht				
22.000.000	Thailand Government Bond**	0,75 %	17.09.2024	637.606	0,98
1.500.000	Thailand Government Bond**	0,95 %	17.06.2025	43.100	0,07
1.330.000	Thailand Government Bond**	1,45 %	17.12.2024	38.640	0,06
5.388.000	Thailand Government Bond*	1,59 %	17.12.2035	139.751	0,22
6.540.000	Thailand Government Bond**	1,60 %	17.12.2029	181.855	0,28
2.430.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.12.2031	67.991	0,10
3.700.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.06.2042	92.522	0,14
800.000	Thailand Government Bond**	2,40 %	17.03.2029	23.373	0,04
2.300.000	Thailand Government Bond**	2,65 %	17.06.2028	68.017	0,10
250.000	Thailand Government Bond**	2,88 %	17.12.2028	7.470	0,01
62.000	Thailand Government Bond**	2,88 %	17.06.2046	1.666	0,00
3.332.000	Thailand Government Bond**	3,30 %	17.06.2038	101.939	0,16
6.968.000	Thailand Government Bond**	3,35 %	17.06.2033	215.195	0,33
5.400.000	Thailand Government Bond**	3,39 %	17.06.2037	167.605	0,26
3.600.000	Thailand Government Bond**	3,45 %	17.06.2043	110.675	0,17
200.000	Thailand Government Bond**	3,78 %	25.06.2032	6.333	0,01
	Thailändischer Baht insgesamt			**1.903.738**	**2,93**
	US-Dollar				
200.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	5,38 %	22.05.2033	203.206	0,31
200.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	6,25 %	31.10.2028	211.476	0,32
800.000	Bermuda Government International Bond*	3,72 %	25.01.2027	777.000	1,19
400.000	Bermuda Government International Bond*	5,00 %	15.07.2032	397.800	0,61
200.000	Chile Government International Bond*	3,25 %	21.09.2071	134.776	0,21
200.000	Chile Government International Bond*	4,34 %	07.03.2042	179.318	0,28
200.000	Export-Import Bank of Korea*	4,50 %	15.09.2032	199.915	0,31
90.000	Hungary Government International Bond*	7,63 %	29.03.2041	107.837	0,17
1.460.000	Indonesia Government International Bond*	8,50 %	12.10.2035	1.945.450	2,99
359.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp*	1,75 %	15.04.2026	331.735	0,51
1.356.000	Mexico Government International Bond*	5,75 %	12.10.2110	1.218.604	1,87
1.100.000	Mexico Government International Bond*	6,35 %	09.02.2035	1.155.097	1,78
750.000	Panama Bonos del Tesoro*	6,38 %	25.07.2033	704.625	1,08
200.000	Panama Government International Bond*	4,50 %	01.04.2056	134.818	0,21
588.000	Panama Government International Bond*	4,50 %	19.01.2063	386.148	0,59
400.000	Panama Government International Bond*	6,40 %	14.02.2035	391.427	0,60

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 74,18 % (31. Dezember 2022: 77,91 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.808.000	Panama Government International Bond*	6,70 %	26.01.2036	1.796.231	2,76
1.530.000	Peruvian Government International Bond*	8,75 %	21.11.2033	1.930.147	2,97
200.000	Philippine Government International Bond*	6,38 %	23.10.2034	227.051	0,35
260.000	Philippine Government International Bond*	9,50 %	02.02.2030	327.763	0,50
100.000	Republic of Poland Government International Bond*	4,88 %	04.10.2033	101.627	0,16
124.000	Romanian Government International Bond*	7,63 %	17.01.2053	139.331	0,21
480.000	UAE International Government Bond*	4,95 %	07.07.2052	472.835	0,73
600.000	Uruguay Government International Bond*	4,38 %	23.01.2031	596.574	0,92
280.000	Uruguay Government International Bond*	5,10 %	18.06.2050	281.845	0,43
300.000	Uruguay Government International Bond*	7,88 %	15.01.2033	368.035	0,57
	US-Dollar insgesamt			**14.720.671**	**22,63**
	Uruguayischer Peso				
938.196	Uruguay Government International Bond*	8,25 %	21.05.2031	22.282	0,03
7.654.000	Uruguay Government International Bond*	8,50 %	15.03.2028	189.265	0,29
714.753	Uruguay Government International Bond*	9,75 %	20.07.2033	18.531	0,03
	Uruguayischer Peso insgesamt			**230.078**	**0,35**
	Staatsanleihen insgesamt			**48.266.565**	**74,18**
	Anlagen insgesamt			**58.327.322**	**89,64**

Devisenterminkontrakte 3,57 % (31. Dezember 2022: 0,83 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
100.865.485 CLP	113.929 US$	20.03.2024	Morgan Stanley	1	1.110	0,00
133.160 €	3.265.141 CZK	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	1.763	0,00
465.408 €	509.243 US$	05.02.2024	Barclays Bank Plc	1	5.590	0,01
403.886 €	442.332 US$	04.01.2024	Barclays Bank Plc	2	3.839	0,01
55.343 €	240.866 PLN	20.03.2024	Citibank NA	1	137	0,00
201.156 €	217.235 US$	03.01.2024	Citibank NA	1	4.972	0,01
213.992 €	234.415 US$	04.01.2024	Citibank NA	2	1.981	0,00
417.818 €	455.057 US$	04.01.2024	Goldman Sachs International	3	6.503	0,01
131.430 €	571.746 PLN	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	394	0,00
272.037 €	295.489 US$	17.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	5.190	0,01
19.416 €	21.260 US$	04.01.2024	Morgan Stanley	1	189	0,00
13.994.601 HUF	36.300 €	06.02.2024	Goldman Sachs International	1	93	0,00
13.411.834 HUF	34.805 €	06.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	71	0,00
1.061.637.042 IDR	67.846 US$	07.02.2024	BNP Paribas	1	1.013	0,00
1.577.567.380 IDR	99.976 US$	07.02.2024	Deutsche Bank AG	1	2.346	0,00
101.663 ILS	27.417 US$	25.01.2024	Goldman Sachs International	1	828	0,00

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 3,57 % (31. Dezember 2022: 0,83 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
24.697.017 INR	296.245 US$	22.01.2024	Citibank NA	1	274	0,00
8.409.370 INR	100.805 US$	08.02.2024	Standard Chartered Bank	1	89	0,00
139.022.876 KRW	107.166 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	539	0,00
140.921.999 KRW	106.937 US$	16.01.2024	Morgan Stanley	1	1.787	0,00
141.814.464 KRW	109.253 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	614	0,00
3.289.564 MXN	186.764 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	5.048	0,01
2.002.084 MXN	113.249 US$	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	3.491	0,01
5.420.572 MXN	310.417 US$	20.02.2024	Standard Chartered Bank	1	7.088	0,01
466.231 MYR	98.642 US$	23.01.2024	HSBC Bank Plc	1	3.150	0,01
1.461.287 MYR	315.034 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	5.396	0,01
493.330 MYR	105.688 US$	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.924	0,00
952.187 MYR	205.368 US$	07.03.2024	Standard Chartered Bank	1	3.259	0,01
694.601 PEN	181.657 US$	18.01.2024	Barclays Bank Plc	1	5.850	0,01
121.652 PEN	32.244 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	595	0,00
203.151 PEN	52.356 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	2.485	0,00
5.611.504 PHP	100.147 US$	06.02.2024	HSBC Bank Plc	1	1.153	0,00
638.440 RON	127.974 €	19.01.2024	Citibank NA	2	275	0,00
338.343 RON	67.832 €	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	133	0,00
134.271 SGD	98.718 US$	22.01.2024	Morgan Stanley	1	3.167	0,01
1.385.060 THB	40.011 US$	20.03.2024	BNP Paribas	1	841	0,00
5.224.125 THB	150.143 US$	22.01.2024	Citibank NA	1	3.184	0,01
9.177.413 THB	263.573 US$	20.03.2024	Goldman Sachs International	2	7.113	0,01
7.505.966 THB	213.988 US$	08.01.2024	Standard Chartered Bank	1	6.006	0,01
3.828.842 THB	107.166 US$	16.01.2024	Standard Chartered Bank	1	5.140	0,01
3.103.288 THB	89.135 US$	20.03.2024	Standard Chartered Bank	1	2.395	0,00
6.613.403 TWD	207.871 US$	12.01.2024	HSBC Bank Plc	1	9.126	0,01
3.402.426 TWD	108.610 US$	08.01.2024	Standard Chartered Bank	1	2.779	0,01
68.058 US$	3.761.956 PHP	20.03.2024	Citibank NA	1	148	0,00
11.448 US$	14.645.933 KRW	20.03.2024	Citibank NA	1	101	0,00
16.814.679 US$	15.197.208 €	02.02.2024	Citibank NA	1	5.449	0,01
109.718 US$	142.071.225 KRW	16.01.2024	HSBC Bank Plc	1	107	0,00
67.110 US$	60.349 €	05.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	352	0,00
148.304 US$	192.031.198 KRW	22.01.2024	Morgan Stanley	1	79	0,00
2.170.860 UYU	53.948 US$	09.02.2024	Citibank NA	1	1.509	0,00
4.305.746 UYU	107.509 US$	27.03.2024	Citibank NA	1	1.885	0,00
770.681 UYU	19.029 US$	09.02.2024	Goldman Sachs International	1	659	0,00
2.410.306 UYU	59.579 US$	09.02.2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.994	0,00
Abgesicherte Klassen AUD						
15.155.801 AUD	10.006.122 US$	14.03.2024	BNP Paribas	1	357.967	0,55

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 3,57 % (31. Dezember 2022: 0,83 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)						
631.829 AUD	418.971 US$	14.03.2024	State Street Bank and Trust Co	3	13.097	0,02
Abgesicherte Klassen NOK						
2.918.020 NOK	269.273 US$	14.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	18.523	0,03
258.400.586 NOK	23.681.056 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	8	1.804.241	2,77
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**2.325.031**	**3,57**

Futures-Kontrakte 1,28 % (31. Dezember 2022: 1,12 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
21	Euro-BOBL Future March 2024	59.434	0,09
1	Euro-Schatz Future March 2024	502	0,00
1	South Korea 10-Year Bond Future March 2024	1.188	0,00
9	South Korea 3-Year Bond Future March 2024	2.236	0,00
9	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024	20.320	0,03
32	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	81.828	0,13
30	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024	292.094	0,45
29	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	374.508	0,58
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**832.110**	**1,28**

Zinsswap-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)

Nominalwert		Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
MXN	2.313.879	30.10.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	9,26 %	28D MXIBTIIE	3.663	0,01
CZK	1.892.163	25.07.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,19 %	6M PRIBOR	2.093	0,01
COP	193.997.409	06.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	6,40 %	1D COOVIBR	1.955	0,01
COP	711.742.190	13.04.2024	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	8,37 %	1D COOVIBR	1.899	0,00
MXN	2.318.249	17.08.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	8,94 %	28D MXIBTIIE	1.686	0,00
MXN	6.749.247	25.03.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	9,33 %	28D MXIBTIIE	1.603	0,00
MXN	2.318.248	17.08.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	8,91 %	28D MXIBTIIE	1.529	0,00
CZK	17.495.416	22.12.2025	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,47 %	6M PRIBOR	1.510	0,00
COP	125.606.377	07.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	6,45 %	1D COOVIBR	1.219	0,00
CLP	6.474.990	05.06.2030	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	2,33 %	1D CLICP	997	0,00
COP	186.628.026	31.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	7,14 %	1D COOVIBR	927	0,00
MYR	1.339.938	20.12.2025	Goldman Sachs International	(Zahlung)	3,50 %	3M KLIBOR	57	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten ∞							**19.138**	**0,03**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**61.503.601**	**94,52**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,43 %) (31. Dezember 2022: (0,63 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
81.403.218 CLP	92.902 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	(60)	(0,00)
15.197.208 €	16.794.890 US$	03.01.2024	Citibank NA	1	(7.293)	(0,01)
147.872 €	737.555 RON	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(284)	(0,00)
36.010.214 HUF	93.973 €	06.02.2024	Goldman Sachs International	1	(389)	(0,00)
192.031.198 KRW	149.087 US$	22.01.2024	Citibank NA	1	(862)	(0,00)
440.899 PLN	101.156 €	20.03.2024	Citibank NA	1	(87)	(0,00)
1.834.523 PLN	421.207 €	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	(707)	(0,00)
145.168 RON	29.158 €	19.01.2024	Barclays Bank Plc	1	(3)	(0,00)
671.145 US$	615.451 €	04.01.2024	Barclays Bank Plc	3	(8.739)	(0,01)
187.703 US$	170.941 €	05.02.2024	Citibank NA	2	(1.392)	(0,00)
110.691 US$	3.857.768 THB	16.01.2024	Citibank NA	1	(2.464)	(0,01)
68.127 US$	1.198.823 MXN	20.03.2024	Citibank NA	1	(1.776)	(0,00)
7.384 US$	9.639.523 KRW	20.03.2024	Citibank NA	1	(84)	(0,00)
298.358 US$	272.037 €	17.01.2024	Citibank NA	1	(2.321)	(0,00)
88.486 US$	340.033 PEN	18.01.2024	Citibank NA	1	(3.306)	(0,01)
103.507 US$	141.064 SGD	22.01.2024	Citibank NA	1	(3.532)	(0,01)
108.041 US$	99.611 €	04.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(1.998)	(0,00)
22.048 US$	340.843.800 IDR	07.02.2024	Deutsche Bank AG	1	(60)	(0,00)
196.821 US$	802.263.729 COP	20.03.2024	Goldman Sachs International	1	(7.071)	(0,01)
436.389 US$	1.769.639.501 COP	01.02.2024	Goldman Sachs International	1	(17.468)	(0,03)
148.912 US$	5.224.125 THB	22.01.2024	Goldman Sachs International	1	(4.415)	(0,01)
216.818 US$	200.597 €	04.01.2024	Goldman Sachs International	1	(4.780)	(0,01)
32.879 US$	152.512 MYR	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	(564)	(0,00)
89.582 US$	1.389.183.027 IDR	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	(501)	(0,00)
128.928 US$	5.248.021 UYU	09.02.2024	HSBC Bank Plc	1	(5.138)	(0,01)
10.042 US$	13.106.039 KRW	20.03.2024	HSBC Bank Plc	2	(112)	(0,00)
31.510 US$	1.103.899 THB	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	(1.049)	(0,00)
108.862 US$	3.379.606 TWD	08.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.780)	(0,00)
43.575 US$	201.950 MYR	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(708)	(0,00)
34.047 US$	527.248.109 IDR	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(143)	(0,00)
102.553 US$	485.792 MYR	23.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(3.510)	(0,01)
27.457 US$	110.436.667 COP	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(610)	(0,00)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,43 %) (31. Dezember 2022: (0,63 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
151.122 US$	139.454 €	04.01.2024	Morgan Stanley	1	(2.931)	(0,01)
208.985 US$	782.543 PEN	18.01.2024	Morgan Stanley	1	(2.262)	(0,00)
124.104 US$	1.942.270.600 IDR	20.03.2024	Standard Chartered Bank	1	(1.844)	(0,00)
16.491.153 US$	15.071.364 €	03.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(157.432)	(0,24)
359.112 US$	327.000 €	03.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(2.109)	(0,00)
218.204 US$	6.982.751 TWD	12.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(10.912)	(0,02)
Abgesicherte Klassen NOK						
7.992 NOK	790 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
364.691 US$	3.936.357 NOK	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	(23.541)	(0,03)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(284.238)**	**(0,43)**

Futures-Kontrakte (0,55 %) (31. Dezember 2022: (0,12 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
(25)	Euro-BOBL Future March 2024	(43.357)	(0,07)
(63)	Euro-Bund Future March 2024	(234.628)	(0,36)
(8)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024	(78.916)	(0,12)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(356.901)**	**(0,55)**

Zinsswap-Kontrakte (0,06 %) (31. Dezember 2022: (0,25 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
INR	21.347.652	19.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	6,21 %	1D MIBOR	(7)	(0,00)
CLP	130.694.684	24.10.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	6,12 %	1D CLICP	(16)	(0,00)
PLN	535.134	07.11.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,51 %	6M WIBOR	(617)	(0,00)
CLP	17.013.289	09.11.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	1,24 %	1D CLICP	(1.396)	(0,00)
PLN	417.496	10.10.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,76 %	6M WIBOR	(1.565)	(0,00)
PLN	534.271	01.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,72 %	6M WIBOR	(1.750)	(0,00)
CLP	94.826.734	13.04.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	7,51 %	1D CLICP	(2.353)	(0,00)
COP	129.448.750	11.08.2032	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	9,02 %	1D COOVIBR	(2.903)	(0,01)
PLN	294.489	02.10.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,99 %	6M WIBOR	(2.968)	(0,01)
PLN	431.789	03.10.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	5,01 %	6M WIBOR	(4.525)	(0,01)
COP	1.721.774.842	07.06.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	10,29 %	1D COOVIBR	(5.324)	(0,01)
MXN	2.369.982	08.10.2038	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	9,77 %	28D MXIBTIIE	(15.019)	(0,02)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten ∞							**(38.443)**	**(0,06)**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

[1]Zentral abgewickelter Swap.

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(679.582)**	**(1,04)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**60.824.019**	**93,48**
Sonstiges Nettovermögen	**4.243.530**	**6,52**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**65.067.549**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	51.464.560	78,12
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	6.665.974	10,12
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	196.788	0,30
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	475.209	0,72
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	2.021.488	3,07
Anlagen insgesamt		**60.824.019**	**92,33**

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 96,27 % (31. Dezember 2022: 98,40 %)		
	Brasilianischer Real		
247.975	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao*	741.934	0,82
96.014	Banco BTG Pactual SA*	742.623	0,82
101.318	Banco do Brasil SA*	1.154.968	1,27
93.121	Embraer SA*	425.836	0,47
122.637	Equatorial Energia SA*	902.158	0,99
121.315	Petroleo Brasileiro SA - Preferred Shares*	925.610	1,02
	Brasilianischer Real insgesamt	**4.893.129**	**5,39**
	Kanadischer Dollar		
27.871	Parex Resources Inc**	527.363	0,58
	Kanadischer Dollar insgesamt	**527.363**	**0,58**
	Chinesischer Yuan Renminbi		
203.300	Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A*	431.691	0,48
4.386	Kweichow Moutai Co Ltd Class A*	1.063.146	1,17
269.704	NARI Technology Co Ltd Class A*	845.405	0,93
41.500	Proya Cosmetics Co Ltd Class A*	579.319	0,64
94.600	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A*	838.840	0,93
21.600	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co Ltd Class A*	881.521	0,97
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt	**4.639.922**	**5,12**
	Hongkong-Dollar		
44.400	AIA Group Ltd*	386.937	0,43
258.624	Alibaba Group Holding Ltd*	2.503.919	2,76
2.899.000	China Construction Bank Corp - H Shares*	1.726.358	1,90
22.100	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd*	758.502	0,84
108.900	Tencent Holdings Ltd*	4.094.619	4,51
71.000	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares*	476.452	0,53
36.100	WuXi AppTec Co Ltd - H Shares*	367.308	0,40
	Hongkong-Dollar insgesamt	**10.314.095**	**11,37**
	Ungarischer Forint		
15.375	OTP Bank Nyrt*	702.084	0,78
33.465	Richter Gedeon Nyrt*	846.284	0,93
	Ungarischer Forint insgesamt	**1.548.368**	**1,71**
	Indische Rupie		
16.367	Apollo Hospitals Enterprise Ltd*	1.122.685	1,24
186.989	Aptus Value Housing Finance India Ltd*	718.957	0,79
122.450	ASK Automotive Ltd*	425.414	0,47
135.733	ASK Automotive Ltd 2*	464.841	0,51

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 96,27 % (31. Dezember 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)		
	Indische Rupie (Fortsetzung)		
6.596	Bajaj Finance Ltd*	579.433	0,64
3.711	Best Agrolife Ltd*	37.501	0,04
503.968	Bharat Electronics Ltd*	1.111.332	1,23
34.899	Bharti Airtel Ltd*	431.972	0,48
63.678	Cholamandalam Investment & Finance Co Ltd*	962.665	1,06
19.557	GMM Pfaudler Ltd*	378.384	0,42
45.921	HDFC Bank Ltd*	942.549	1,04
9.420	Hero MotoCorp Ltd*	469.337	0,52
74.149	ICICI Bank Ltd*	889.641	0,98
71.155	IndusInd Bank Ltd*	1.364.634	1,50
44.074	JB Chemicals & Pharmaceuticals Ltd*	857.950	0,95
15.350	Kaynes Technology India Ltd*	481.637	0,53
21.968	Larsen & Toubro Ltd*	929.262	1,02
32.731	Rainbow Children's Medicare Ltd*	468.070	0,52
36.038	Reliance Industries Ltd*	1.120.371	1,23
45.079	Sun Pharmaceutical Industries Ltd*	683.089	0,75
91.727	Syrma SGS Technology Ltd*	735.789	0,81
114.966	Texmaco Rail & Engineering Ltd*	235.559	0,26
12.158	Tube Investments of India Ltd*	517.214	0,57
25.071	Venus Pipes & Tubes Ltd*	422.401	0,47
6.754	Voltamp Transformers Ltd*	529.030	0,58
	Indische Rupie insgesamt	**16.879.717**	**18,61**
	Indonesische Rupiah		
875.100	Bank Central Asia Tbk PT*	534.256	0,59
3.047.100	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	1.063.724	1,17
	Indonesische Rupiah insgesamt	**1.597.980**	**1,76**
	Mexikanischer Peso		
139.571	Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O*	1.410.174	1,56
247.598	Wal-Mart de Mexico SAB de CV*	1.043.788	1,15
	Mexikanischer Peso insgesamt	**2.453.962**	**2,71**
	Neuer taiwanesischer Dollar		
49.200	Accton Technology Corp*	838.422	0,93
110.000	Chroma ATE Inc*	763.428	0,84
265.000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd*	689.041	0,76
7.000	Global Unichip Corp*	396.866	0,44
119.425	Hiwin Technologies Corp*	914.448	1,01
21.000	Jentech Precision Industrial Co Ltd*	526.189	0,58

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 96,27 % (31. Dezember 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)		
	Neuer taiwanesischer Dollar (Fortsetzung)		
42.000	MediaTek Inc*	1.389.029	1,53
434.000	Uni-President Enterprises Corp*	1.053.518	1,16
	Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt	**6.570.941**	**7,25**
	Philippinischer Peso		
385.320	BDO Unibank Inc*	908.068	1,00
46.580	SM Investments Corp*	733.503	0,81
	Philippinischer Peso insgesamt	**1.641.571**	**1,81**
	Polnischer Zloty		
8.423	Dino Polska SA*	986.834	1,09
	Polnischer Zloty insgesamt	**986.834**	**1,09**
	Britisches Pfund		
36.808	Antofagasta Plc*	788.069	0,87
20.674	Rio Tinto Plc*	1.539.672	1,70
	Britisches Pfund insgesamt	**2.327.741**	**2,57**
	Saudi-Arabischer Riyal		
103.029	Ades Holding Co*	662.683	0,73
40.475	Al Rajhi Bank*	938.454	1,04
22.653	Al-Dawaa Medical Services Co*	637.476	0,70
66.150	Alinma Bank*	683.081	0,75
99.091	Saudi Arabian Oil Co*	872.412	0,96
	Saudi-Arabischer Riyal insgesamt	**3.794.106**	**4,18**
	Südafrikanischer Rand		
46.931	Bid Corp Ltd*	1.094.907	1,21
	Südafrikanischer Rand insgesamt	**1.094.907**	**1,21**
	Südkoreanischer Won		
1.181	LG Chem Ltd*	454.240	0,50
6.714	Orion Corp*	602.515	0,67
102.347	Samsung Electronics Co Ltd*	6.212.140	6,85
31.604	Samsung Engineering Co Ltd*	707.970	0,78
22.433	SK Hynix Inc*	2.448.292	2,70
	Südkoreanischer Won insgesamt	**10.425.157**	**11,50**

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 96,27 % (31. Dezember 2022: 98,40 %) (Fortsetzung)		
	Thailändischer Baht		
184.700	Bangkok Bank PCL*	846.746	0,93
	Thailändischer Baht insgesamt	**846.746**	**0,93**
	VAE-Dirham		
776.629	Adnoc Gas Plc*	653.403	0,72
557.803	Dubai Islamic Bank PJSC*	868.731	0,96
	Gesamt VAE-Dirham	**1.522.134**	**1,68**
	US-Dollar		
7.675	Baidu Inc ADR*	914.016	1,01
5.295	Credicorp Ltd*	793.879	0,87
3.724	Globant SA*	886.237	0,98
41.431	KE Holdings Inc ADR*	671.596	0,74
12.880	Las Vegas Sands Corp*	633.825	0,70
7.517	NetEase Inc ADR*	700.284	0,77
2.595	NVIDIA Corp*	1.285.096	1,42
11.357	PDD Holdings Inc ADR*	1.661.643	1,83
64.996	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR*	6.759.584	7,45
25.878	Trip.com Group Ltd ADR*	931.867	1,03
	US-Dollar insgesamt	**15.238.027**	**16,80**
	Aktien insgesamt	**87.302.700**	**96,27**
	Immobilienaktiengesellschaften 0,53 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)		
	Mexikanischer Peso		
244.957	FIBRA Macquarie Mexico	481.105	0,53
	Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *	**481.105**	**0,53**
	Anlagen insgesamt	**87.783.805**	**96,80**

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,40 % (31. Dezember 2022: 0,55 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen AUD						
223.365 AUD	146.649 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	11	5.843	0,01
8.137.658 AUD	5.239.690 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	40	315.933	0,35
Abgesicherte Klassen CAD						
1.379.326 CAD	1.018.434 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	11	27.859	0,03
538.802 CAD	396.891 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	4	11.819	0,01
11.239.614 CAD	8.287.320 US$	18.01.2024	UBS AG	5	238.520	0,26
11.107.692 CAD	8.184.525 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	241.245	0,27
Abgesicherte Klassen EUR						
50.583 €	55.326 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	586	0,00
2.748.383 €	2.929.475 US$	18.01.2024	UBS AG	10	108.416	0,12
2.695.517 €	2.871.424 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	12	108.032	0,12
11 US$	10 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
20.766 £	25.626 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	849	0,00
472.939 £	581.218 US$	18.01.2024	UBS AG	8	21.738	0,02
58.917 £	73.159 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	13	1.954	0,00
Abgesicherte Klassen ZAR						
68.578.969 ZAR	3.559.525 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	11	185.519	0,21
1.192.823 ZAR	63.373 US$	18.01.2024	UBS AG	3	1.766	0,00
2.097.994 ZAR	112.238 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	53	2.330	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**1.272.409**	**1,40**

	Zeitwert US$	% des #Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**89.056.214**	**98,20**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,87 %) (31. Dezember 2022: (0,35 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen AUD						
20.307 AUD	13.884 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(21)	(0,00)
17.064 AUD	11.683 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(33)	(0,00)
57.592 US$	89.872 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	(3.763)	(0,01)
40.789 US$	62.545 AUD	18.01.2024	UBS AG	4	(1.912)	(0,00)
3.948.597 US$	6.133.856 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	18	(239.019)	(0,27)
Abgesicherte Klassen CAD						
394.597 US$	536.940 CAD	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	(12.701)	(0,02)
529.804 US$	725.662 CAD	18.01.2024	Royal Bank of Canada	8	(20.649)	(0,02)

Emerging Markets Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,87 %) (31. Dezember 2022: (0,35 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen CAD (Fortsetzung)						
44.727 US$	61.128 CAD	18.01.2024	UBS AG	1	(1.642)	(0,00)
8.104.827 US$	10.998.521 CAD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(238.131)	(0,26)
Abgesicherte Klassen EUR						
22.123 €	24.494 US$	18.01.2024	UBS AG	2	(41)	(0,00)
64.142 US$	59.456 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(1.577)	(0,00)
2.024.610 US$	1.899.671 €	18.01.2024	UBS AG	3	(75.168)	(0,08)
2.408.375 US$	2.261.664 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	13	(91.527)	(0,10)
Abgesicherte Klassen GBP						
2.464 £	3.152 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(10)	(0,00)
4.817 £	6.143 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
11.775 US$	9.597 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(460)	(0,00)
16.331 US$	13.169 £	18.01.2024	UBS AG	3	(459)	(0,00)
51.936 US$	41.960 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	10	(1.560)	(0,00)
Abgesicherte Klassen ZAR						
1.777.609 US$	34.240.014 ZAR	18.01.2024	Goldman Sachs International	12	(92.211)	(0,10)
11.656 US$	223.045 ZAR	18.01.2024	UBS AG	1	(524)	(0,00)
279.663 US$	5.225.452 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	28	(5.696)	(0,01)
718.562 ZAR	39.286 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(46)	(0,00)
24.500 ZAR	1.339 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(1)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(787.152)**	**(0,87)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(787.152)**	**(0,87)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**88.269.062**	**97,33**
Sonstiges Nettovermögen	**2.418.439**	**2,67**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**90.687.501**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	87.256.442	94,18
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	527.363	0,57
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	485.257	0,52
Anlagen insgesamt		**88.269.062**	**95,27**

Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Netto-vermögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,04 % (31. Dezember 2022: 4,98 %)				
	Euro				
4.284	Gedesco Trade Receivables 2020-1 DAC Class A	5,03 %	24.01.2026	4.100	0,04
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **			**4.100**	**0,04**
	Unternehmensanleihen 45,11 % (31. Dezember 2022: 43,88 %)				
	Euro				
100.000	AMCO - Asset Management Co SpA*	0,75 %	20.04.2028	87.958	0,83
110.000	AMCO - Asset Management Co SpA*	4,63 %	06.02.2027	113.044	1,07
100.000	Aroundtown SA*	0,38 %	15.04.2027	80.695	0,76
100.000	Athene Global Funding*	0,83 %	08.01.2027	92.362	0,87
100.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd*	1,63 %	11.03.2081	90.478	0,86
100.000	Bank of New Zealand*	2,55 %	29.06.2027	98.515	0,93
90.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	3,21 %	29.12.2049	75.708	0,72
100.000	Bayerische Landesbank*	7,00 %	05.01.2034	103.766	0,98
100.000	BCP V Modular Services Finance II Plc**	4,75 %	30.11.2028	93.162	0,88
100.000	BNP Paribas Fortis SA*	3,75 %	30.10.2028	104.338	0,99
100.000	BPCE SFH SA*	3,13 %	24.01.2028	101.394	0,96
100.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA*	3,00 %	11.01.2030	101.185	0,96
100.000	Canadian Imperial Bank of Commerce*	3,25 %	31.03.2027	100.938	0,95
100.000	Carmila SA*	5,50 %	09.10.2028	103.816	0,98
100.000	Cie de Financement Foncier SA*	2,00 %	07.05.2024	99.370	0,94
100.000	Cirsa Finance International Sarl*	4,50 %	15.03.2027	96.531	0,91
100.000	Commerzbank AG*	6,75 %	05.10.2033	106.700	1,01
100.000	Commonwealth Bank of Australia*	0,75 %	28.02.2028	91.719	0,87
100.000	Commonwealth Bank of Australia*	3,25 %	24.10.2025	100.284	0,95
100.000	CPI Property Group SA*	2,75 %	12.05.2026	83.735	0,79
100.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA*	0,13 %	16.12.2024	96.975	0,92
100.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA*	3,13 %	18.10.2030	101.774	0,96
100.000	Cullinan Holdco Scsp**	4,63 %	15.10.2026	78.170	0,74
100.000	Dexia Credit Local SA*	0,63 %	17.01.2026	95.783	0,91
100.000	Digital Intrepid Holding BV*	1,38 %	18.07.2032	81.651	0,77
100.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,38 %	31.08.2081	85.583	0,81
100.000	Fastighets AB Balder*	1,88 %	23.01.2026	91.352	0,86
100.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec*	2,88 %	28.11.2024	99.383	0,94
100.000	Global Payments Inc*	4,88 %	17.03.2031	105.239	0,99
100.000	Grand City Properties SA*	5,90 %	29.12.2049	57.362	0,54
100.000	Heimstaden Bostad AB*	3,38 %	29.12.2049	42.464	0,40
100.000	Iceland Bondco Plc**	9,50 %	15.12.2027	100.200	0,95
100.000	Imerys SA*	4,75 %	29.11.2029	101.772	0,96
100.000	Kleopatra Holdings 2 SCA*	6,50 %	01.09.2026	54.079	0,51

Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 45,11 % (31. Dezember 2022: 43,88 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
55.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,00 %	15.09.2031	45.574	0,43
100.000	Loxam SAS*	6,38 %	15.05.2028	104.390	0,99
100.000	Loxam SAS*	6,38 %	31.05.2029	103.847	0,98
100.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88 %	01.10.2026	76.463	0,72
100.000	National Australia Bank Ltd*	2,35 %	30.08.2029	96.811	0,92
100.000	National Grid North America Inc*	4,67 %	12.09.2033	106.939	1,01
100.000	Pinnacle Bidco Plc*	8,25 %	11.10.2028	104.254	0,99
100.000	Sogecap SA*	6,50 %	16.05.2044	108.177	1,02
130.000	Southern Co*	1,88 %	15.09.2081	111.817	1,06
100.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd*	4,09 %	19.04.2028	103.685	0,98
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	7,38 %	15.09.2029	109.699	1,04
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc*	4,38 %	18.01.2031	94.808	0,90
100.000	Traton Finance Luxembourg SA*	4,50 %	23.11.2026	102.216	0,97
100.000	UBS Group AG*	2,13 %	13.10.2026	97.239	0,92
100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE*	7,25 %	29.12.2049	100.365	0,95
100.000	Volkswagen International Finance NV*	3,88 %	29.12.2049	91.933	0,87
100.000	Westpac Banking Corp*	0,38 %	02.04.2026	94.369	0,89
	Unternehmensanleihen insgesamt			**4.770.071**	**45,11**
	Staatsanleihen 51,07 % (31. Dezember 2022: 43,09 %)				
	Euro				
100.000	Acquirente Unico SpA*	2,80 %	20.02.2026	98.254	0,93
75.000	Autonomous Community of Madrid Spain*	2,08 %	12.03.2030	71.540	0,68
100.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	3,00 %	30.05.2029	97.763	0,92
100.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	4,00 %	08.09.2027	101.992	0,96
52.000	Bulgaria Government International Bond*	4,88 %	13.05.2036	55.781	0,53
55.600	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00 %	15.08.2030	49.206	0,47
92.163	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	1,25 %	15.08.2048	74.909	0,71
134.071	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	1,70 %	15.08.2032	131.322	1,24
52.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	4,75 %	04.07.2034	65.105	0,62
100.000	Caisse Francaise de Financement Local*	3,50 %	20.03.2029	103.567	0,98
20.000	European Financial Stability Facility*	2,88 %	16.02.2033	20.425	0,19
83.000	European Financial Stability Facility*	3,50 %	11.04.2029	87.134	0,82
90.000	European Stability Mechanism*	1,00 %	23.06.2027	85.752	0,81
50.000	European Stability Mechanism*	3,00 %	23.08.2033	51.706	0,49
111.000	European Union*	2,00 %	04.10.2027	109.374	1,03
220.000	European Union*	3,25 %	04.07.2034	230.754	2,18
99.000	European Union*	3,38 %	04.10.2038	104.070	0,98
95.000	European Union*	1,63 %	04.12.2029	90.691	0,86

Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 51,07 % (31. Dezember 2022: 43,09 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
69.000	European Union*	2,75 %	04.12.2037	67.775	0,64
25.555	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.05.2052	14.679	0,14
180.381	French Republic Government Bond OAT*	1,25 %	25.05.2038	147.045	1,39
63.491	French Republic Government Bond OAT*	1,50 %	25.05.2031	59.986	0,57
54.000	French Republic Government Bond OAT*	1,50 %	25.05.2050	39.292	0,37
12.650	French Republic Government Bond OAT*	1,75 %	25.05.2066	9.066	0,09
125.000	Hellenic Republic Government Bond*	4,38 %	18.07.2038	137.835	1,30
55.000	Instituto de Credito Oficial*	3,80 %	31.05.2029	57.810	0,55
21.000	Ireland Government Bond*	0,55 %	22.04.2041	14.756	0,14
20.800	Ireland Government Bond*	3,00 %	18.10.2043	21.652	0,21
55.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,00 %	01.08.2026	51.244	0,49
46.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,25 %	15.03.2028	41.246	0,39
85.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,20 %	15.08.2025	82.658	0,78
48.973	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,40 %	26.05.2025	48.200	0,46
60.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,45 %	01.03.2036	46.225	0,44
136.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,60 %	01.06.2026	132.299	1,25
169.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,75 %	30.05.2024	167.608	1,59
100.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,85 %	01.07.2025	98.321	0,93
62.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	2,05 %	01.08.2027	60.403	0,57
44.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	2,50 %	01.12.2032	40.647	0,38
125.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	3,00 %	01.08.2029	124.582	1,18
143.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	3,40 %	28.03.2025	143.395	1,36
56.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	4,00 %	01.02.2037	56.716	0,54
51.000	Kingdom of Belgium Government Bond*	0,35 %	22.06.2032	42.671	0,40
28.904	Kingdom of Belgium Government Bond*	0,40 %	22.06.2040	19.287	0,18
77.696	Kingdom of Belgium Government Bond*	1,45 %	22.06.2037	65.656	0,62
44.000	Kingdom of Belgium Government Bond*	3,00 %	22.06.2033	45.467	0,43
103.000	Kommunekredit*	0,88 %	03.11.2036	81.939	0,78
90.000	Netherlands Government Bond*	2,50 %	15.07.2033	91.391	0,86
157.000	Netherlands Government Bond*	4,00 %	15.01.2037	183.349	1,73
100.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	0,30 %	17.10.2031	84.436	0,80
116.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	1,65 %	16.07.2032	107.546	1,02
61.500	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	1,95 %	15.06.2029	60.438	0,57
90.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	3,50 %	18.06.2038	94.456	0,89
55.000	Republic of Austria Government Bond*	0,90 %	20.02.2032	48.477	0,46
68.000	Romanian Government International Bond*	1,75 %	13.07.2030	55.114	0,52
117.000	Romanian Government International Bond*	2,12 %	16.07.2031	93.596	0,89
52.000	Romanian Government International Bond**	2,88 %	26.05.2028	48.772	0,46
73.000	Romanian Government International Bond*	3,62 %	26.05.2030	67.302	0,64
40.000	Romanian Government International Bond*	3,88 %	29.10.2035	34.215	0,32

Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 51,07 % (31. Dezember 2022: 43,09 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
70.000	Romanian Government International Bond*	6,38 %	18.09.2033	74.166	0,70
104.000	Romanian Government International Bond*	6,63 %	27.09.2029	111.430	1,05
84.000	Slovenia Government Bond*	1,19 %	14.03.2029	77.902	0,74
49.000	Slovenia Government Bond*	1,50 %	25.03.2035	41.472	0,39
46.000	Slovenia Government Bond*	3,63 %	11.03.2033	48.714	0,46
123.000	Spain Government Bond*	0,85 %	30.07.2037	90.832	0,86
21.000	Spain Government Bond*	2,90 %	31.10.2046	19.020	0,18
50.000	Spain Government Bond*	3,15 %	30.04.2033	50.894	0,48
276.000	Spain Government Bond*	3,55 %	31.10.2033	289.397	2,74
71.000	Spain Government Bond*	4,20 %	31.01.2037	78.665	0,74
	Staatsanleihen insgesamt			**5.399.389**	**51,07**
	Anlagen insgesamt			**10.173.560**	**96,22**

Futures-Kontrakte 0,31 % (31. Dezember 2022: 0,45 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto-vermögens
16	Euro-BOBL Future March 2024	20.960	0,20
1	Euro-BTP Future March 2024	3.120	0,03
1	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024	7.080	0,07
3	Euro-Schatz Future March 2024	1.140	0,01
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**32.300**	**0,31**

Inflation-Swap-Kontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto-vermögens
EUR	375.000	15.11.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,32 %	CPTFEMU	6.642	0,06
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten±							**6.642**	**0,06**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte 0,07 % (31. Dezember 2022: 0,02 %)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto-vermögens
EUR	170.000	26.10.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	3,09 %	1D €STR	7.001	0,07
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten ∞							**7.001**	**0,07**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**10.219.503**	**96,66**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Futures-Kontrakte (0,18 %) (31. Dezember 2022: (0,88 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto-vermögens
(4)	Euro-Bund Future March 2024	(11.080)	(0,10)
(4)	Euro-OAT Future March 2024	(6.950)	(0,07)
5	Euro-BOBL Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 118.00	(977)	(0,01)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(19.007)**	**(0,18)**

Inflation-Swap-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto-vermögens
EUR	375.000	15.11.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	2,21 %	CPTFEMU	(3.665)	(0,03)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten∞							**(3.665)**	**(0,03)**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2022: (0,26 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto-vermögens
EUR	200.031	30.08.2032	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,22 %	6M EURIBOR	(3.982)	(0,04)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten ∞							**(3.982)**	**(0,04)**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,52 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
EUR	680.000	20.12.2028	ICE Clear U.S.[1]	Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S40.V1	(54.486)	(0,52)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt ±					**(54.486)**	**(0,52)**

[1]Zentral abgewickelter Swap.

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(81.140)**	**(0,77)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**10.138.363**	**95,89**
Sonstiges Nettovermögen	**434.731**	**4,11**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**10.573.094**	**100,00**

Portfolioanalyse		EUR	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	9.189.634	85,80
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	983.926	9,18
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	13.293	0,12
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(48.490)	(0,45)
Anlagen insgesamt		**10.138.363**	**94,65**

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Netto-vermögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,46 % (31. Dezember 2022: 4,78 %)				
	Euro				
135.085	Futura S.r.l. Series 2019-1 Class A	6,97 %	31.07.2044	134.607	0,39
25.199	Gedesco Trade Receivables 2020-1 DAC Class A	5,03 %	24.01.2026	24.120	0,07
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **			**158.727**	**0,46**
	Unternehmensanleihen 54,54 % (31. Dezember 2022: 49,33 %)				
	Dänische Krone				
9.905.796	Nykredit Realkredit AS*	4,00 %	01.10.2053	1.314.538	3,86
	Dänische Krone insgesamt			**1.314.538**	**3,86**
	Euro				
100.000	Altice France SA*	3,38 %	15.01.2028	79.638	0,23
100.000	Altice France SA**	4,13 %	15.01.2029	80.222	0,24
250.000	AMCO - Asset Management Co SpA*	0,75 %	20.04.2028	219.895	0,65
150.000	AMCO - Asset Management Co SpA*	4,63 %	06.02.2027	154.151	0,45
100.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd*	3,95 %	17.07.2026	102.387	0,30
200.000	Arkema SA*	1,50 %	29.12.2049	185.815	0,55
300.000	Aroundtown SA*	0,38 %	15.04.2027	242.085	0,71
200.000	Aroundtown SA*	1,63 %	31.01.2028	162.688	0,48
200.000	Aroundtown SA*	3,38 %	29.12.2049	84.304	0,25
300.000	Athene Global Funding*	0,83 %	08.01.2027	277.084	0,81
200.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd*	1,63 %	11.03.2081	180.957	0,53
200.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA*	7,50 %	14.09.2029	210.185	0,62
100.000	Banijay Entertainment SASU**	7,00 %	01.05.2029	105.754	0,31
400.000	Bank of New Zealand*	2,55 %	29.06.2027	394.060	1,16
200.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	3,21 %	29.12.2049	168.240	0,49
300.000	Bayerische Landesbank*	7,00 %	05.01.2034	311.299	0,91
100.000	BPCE SFH SA*	3,13 %	24.01.2028	101.394	0,30
200.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA*	3,00 %	11.01.2030	202.370	0,59
500.000	Canadian Imperial Bank of Commerce*	3,25 %	31.03.2027	504.690	1,48
300.000	Carmila SA*	5,50 %	09.10.2028	311.448	0,92
100.000	Cirsa Finance International Sarl*	4,50 %	15.03.2027	96.531	0,28
300.000	Commerzbank AG*	6,75 %	05.10.2033	320.100	0,94
300.000	Commonwealth Bank of Australia*	0,75 %	28.02.2028	275.157	0,81
100.000	CPI Property Group SA*	1,63 %	23.04.2027	73.713	0,22
100.000	CPI Property Group SA*	2,75 %	12.05.2026	83.735	0,25
400.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA*	3,13 %	18.10.2030	407.096	1,20
100.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA*	2,75 %	08.12.2027	100.001	0,29
300.000	Cullinan Holdco Scsp**	4,63 %	15.10.2026	234.510	0,69
400.000	Digital Intrepid Holding BV*	1,38 %	18.07.2032	326.604	0,96

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 54,54 % (31. Dezember 2022: 49,33 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
200.000	Electricite de France SA*	2,88 %	29.12.2049	185.920	0,55
200.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,38 %	31.08.2081	171.167	0,50
100.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	2,13 %	31.08.2081	78.231	0,23
100.000	Energia Group Roi Financeco DAC**	6,88 %	31.07.2028	104.090	0,31
100.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50 %	30.06.2029	86.532	0,25
100.000	Engie SA*	1,88 %	29.12.2049	83.157	0,24
200.000	Evonik Industries AG*	1,38 %	02.09.2081	177.831	0,52
200.000	Fastighets AB Balder*	1,88 %	23.01.2026	182.703	0,54
300.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec*	2,88 %	28.11.2024	298.150	0,88
300.000	Global Payments Inc*	4,88 %	17.03.2031	315.718	0,93
100.000	Grand City Properties SA*	1,50 %	29.12.2049	45.998	0,14
300.000	Grand City Properties SA*	5,90 %	29.12.2049	172.085	0,51
600.000	Heimstaden Bostad AB*	3,38 %	29.12.2049	254.784	0,75
200.000	Holcim Finance Luxembourg SA*	3,00 %	29.12.2049	198.668	0,58
250.000	HSBC Bank Canada*	1,50 %	15.09.2027	238.395	0,70
200.000	Iberdrola Finanzas SA*	1,58 %	29.12.2049	178.506	0,52
400.000	Iceland Bondco Plc**	9,50 %	15.12.2027	400.800	1,18
300.000	Imerys SA*	4,75 %	29.11.2029	305.314	0,90
100.000	Italmatch Chemicals SpA*	10,00 %	06.02.2028	103.618	0,30
224.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,00 %	15.09.2031	185.610	0,55
467.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau**	0,75 %	28.06.2028	434.590	1,28
551.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,75 %	15.01.2029	507.801	1,49
403.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	1,25 %	30.06.2027	387.508	1,14
190.000	Landsbankinn HF*	6,38 %	12.03.2027	197.040	0,58
200.000	Lloyds Bank Plc*	3,25 %	02.02.2026	200.978	0,59
100.000	Loxam SAS*	6,38 %	15.05.2028	104.390	0,31
200.000	Loxam SAS*	6,38 %	31.05.2029	207.694	0,61
100.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88 %	01.10.2026	76.463	0,22
500.000	National Australia Bank Ltd*	2,35 %	30.08.2029	484.056	1,42
200.000	National Grid North America Inc*	4,67 %	12.09.2033	213.879	0,63
200.000	Pinnacle Bidco Plc*	8,25 %	11.10.2028	208.507	0,61
200.000	Repsol International Finance BV*	2,50 %	29.12.2049	187.594	0,55
200.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	2,63 %	29.12.2049	33.280	0,10
200.000	Sogecap SA*	6,50 %	16.05.2044	216.354	0,64
370.000	Southern Co*	1,88 %	15.09.2081	318.249	0,94
100.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp*	3,60 %	16.02.2026	100.627	0,30
300.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd*	4,09 %	19.04.2028	311.054	0,91
100.000	Syensqo SA*	2,50 %	29.12.2049	95.152	0,28
200.000	Telecom Italia SpA*	6,88 %	15.02.2028	213.508	0,63
200.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,63 %	15.10.2028	171.007	0,50

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 54,54 % (31. Dezember 2022: 49,33 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
400.000	Thames Water Utilities Finance Plc*	4,38 %	18.01.2031	379.231	1,11
300.000	TotalEnergies SE*	2,13 %	29.12.2049	240.788	0,71
200.000	Traton Finance Luxembourg SA*	4,50 %	23.11.2026	204.433	0,60
300.000	UBS Group AG*	2,13 %	13.10.2026	291.718	0,86
300.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE*	7,25 %	29.12.2049	301.094	0,88
400.000	UniCredit SpA**	3,88 %	29.12.2049	342.760	1,01
300.000	Veolia Environnement SA*	2,50 %	29.12.2049	269.270	0,79
300.000	Vodafone Group Plc*	3,00 %	27.08.2080	269.222	0,79
200.000	Volkswagen International Finance NV*	3,88 %	29.12.2049	183.865	0,54
250.000	Westpac Banking Corp*	0,38 %	02.04.2026	235.922	0,69
100.000	Wizz Air Finance Co BV*	1,00 %	19.01.2026	92.202	0,27
	Euro insgesamt			**17.243.626**	**50,68**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**18.558.164**	**54,54**
	Staatsanleihen 42,49 % (31. Dezember 2022: 40,49 %)				
	Tschechische Krone				
9.000.000	Czech Republic Government Bond*	4,90 %	14.04.2034	400.377	1,18
	Tschechische Krone insgesamt			**400.377**	**1,18**
	Euro				
210.000	Acquirente Unico SpA*	2,80 %	20.02.2026	206.333	0,61
857.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	3,00 %	30.05.2029	837.826	2,46
300.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	4,00 %	08.09.2027	305.977	0,90
340.000	Bulgaria Government International Bond*	4,38 %	13.05.2031	357.848	1,05
320.000	Bulgaria Government International Bond*	4,88 %	13.05.2036	343.269	1,01
60.150	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	2,50 %	15.08.2046	62.521	0,18
400.000	Caisse Francaise de Financement Local*	3,50 %	20.03.2029	414.267	1,22
503.000	Croatia Government International Bond*	1,50 %	17.06.2031	451.443	1,33
281.000	European Union*	1,63 %	04.12.2029	268.255	0,79
173.000	European Union*	2,75 %	04.12.2037	169.929	0,50
379.886	European Union*	3,25 %	04.07.2034	398.455	1,17
471.000	European Union*	3,38 %	04.10.2038	495.120	1,46
102.486	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.05.2052	58.869	0,17
406.044	French Republic Government Bond OAT*	1,25 %	25.05.2038	331.003	0,97
165.438	French Republic Government Bond OAT*	1,75 %	25.05.2066	118.570	0,35
613.000	Hellenic Republic Government Bond*	4,38 %	18.07.2038	675.944	1,99
235.000	Instituto de Credito Oficial*	3,80 %	31.05.2029	247.005	0,73
118.000	Ireland Government Bond*	3,00 %	18.10.2043	122.833	0,36
227.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,00 %	01.08.2026	211.496	0,62
506.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,20 %	15.08.2025	492.060	1,45

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 42,49 % (31. Dezember 2022: 40,49 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
175.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,60 %	01.06.2026	170.237	0,50
460.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	1,85 %	01.07.2025	452.275	1,33
257.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	3,40 %	28.03.2025	257.710	0,76
330.390	Netherlands Government Bond*	0,00 %	15.07.2030	287.529	0,84
239.000	Republic of Poland Government International Bond*	3,88 %	14.02.2033	249.934	0,73
291.000	Romanian Government International Bond*	1,75 %	13.07.2030	235.854	0,69
380.000	Romanian Government International Bond*	2,12 %	16.07.2031	303.986	0,89
507.000	Romanian Government International Bond*	3,62 %	26.05.2030	467.425	1,37
280.000	Romanian Government International Bond*	6,38 %	18.09.2033	296.664	0,87
207.000	Romanian Government International Bond*	6,63 %	27.09.2029	221.788	0,65
700.000	Slovenia Government Bond*	1,19 %	14.03.2029	649.183	1,91
313.000	Slovenia Government Bond*	1,50 %	25.03.2035	264.911	0,78
313.000	Slovenia Government Bond*	3,63 %	11.03.2033	331.466	0,97
140.000	Spain Government Bond*	0,50 %	31.10.2031	117.932	0,35
526.000	Spain Government Bond*	0,70 %	30.04.2032	444.312	1,31
650.000	Spain Government Bond*	1,85 %	30.07.2035	572.302	1,68
947.000	Spain Government Bond*	3,55 %	31.10.2033	992.970	2,92
186.000	State of North Rhine-Westphalia Germany*	1,45 %	16.02.2043	144.134	0,42
	Euro insgesamt			**13.029.635**	**38,29**
	Polnischer Zloty				
4.200.000	Republic of Poland Government Bond*	6,00 %	25.10.2033	1.026.138	3,02
	Polnischer Zloty insgesamt			**1.026.138**	**3,02**
	Staatsanleihen insgesamt			**14.456.150**	**42,49**
	Anlagen insgesamt			**33.173.041**	**97,49**

Devisenterminkontrakte 0,08 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettover-mögens
1.890.938 €	14.087.178 DKK	18.01.2024	BNP Paribas	1	864	0,00
439.624 €	10.811.901 CZK	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	2.185	0,01
3.913 €	4.139 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	168	0,00
1.740 €	268.992 ¥	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	10	0,00
13.010 £	14.969 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	36	0,00
252.182 PLN	58.000 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	8	0,00
Abgesicherte Klassen USD						
1.457.909 €	1.587.400 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	21.787	0,07
153.713 US$	138.739 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	325	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**25.383**	**0,08**

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 0,14 % (31. Dezember 2022: 3,09 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
29	Euro-BOBL Future March 2024	37.990	0,11
13	Canadian 2-Year Bond Future March 2024	7.745	0,02
2	Short-Term Euro-BTP Future March 2024	1.300	0,01
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**47.035**	**0,14**

Inflation-Swap-Kontrakte 0,08 % (31. Dezember 2022: 0,13 %)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
EUR	1.500.000	15.11.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,32 %	CPTFEMU	26.569	0,08
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten ∞							**26.569**	**0,08**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte 0,33 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
EUR	1.400.000	26.10.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	3,09 %	1D €STR	57.656	0,17
EUR	2.300.000	26.10.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	3,24 %	1D €STR	56.225	0,16
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten ∞							**113.881**	**0,33**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**33.385.909**	**98,12**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (3,29 %) (31. Dezember 2022: (2,13 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
10.641.433 CZK	432.290 €	18.01.2024	BNP Paribas	1	(1.748)	(0,00)
735.546 CZK	29.931 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(172)	(0,00)
4.606.678 DKK	618.161 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(84)	(0,00)
680.646 €	3.100.874 PLN	18.01.2024	Standard Chartered Bank	3	(32.630)	(0,10)
342.503 €	299.707 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(3.183)	(0,01)
282.268 €	1.265.280 PLN	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(8.777)	(0,03)
12.249 €	10.646 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(30)	(0,00)

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,29 %) (31. Dezember 2022: (2,13 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto-vermögens
1.008.941 ¥	6.526 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(35)	(0,00)
933 US$	882 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(38)	(0,00)
Abgesicherte Klassen USD						
15.119.666 US$	14.189.476 €	18.01.2024	BNP Paribas	1	(510.705)	(1,50)
1.243.088 US$	1.155.344 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(30.722)	(0,09)
199.330 US$	182.482 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(2.148)	(0,01)
15.291.273 US$	14.361.510 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(527.485)	(1,55)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(1.117.757)**	**(3,29)**

Futures-Kontrakte (0,89 %) (31. Dezember 2022: (0,21 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto-vermögens
(8)	10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2024	(944)	(0,00)
15	Euro-BOBL Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 118.00	(2.927)	(0,01)
(12)	Euro-BTP Future March 2024	(37.440)	(0,11)
(37)	Euro-Bund Future March 2024	(102.490)	(0,30)
(19)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024	(134.520)	(0,40)
(12)	Euro-OAT Future March 2024	(23.510)	(0,07)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(301.831)**	**(0,89)**

Inflation-Swap-Kontrakte (0,04 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto-vermögens
EUR	1.500.000	15.11.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	2,21 %	CPTFEMU	(14.661)	(0,04)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten∞							**(14.661)**	**(0,04)**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

[1]Zentral abgewickelter Swap.

Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,53 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
EUR	2.260.000	20.12.2028	ICE Clear U.S.[1]	Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S40	(181.087)	(0,53)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt ±					**(181.087)**	**(0,53)**

[1]Zentral abgewickelter Swap.

Euro Bond Absolute Return - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert EUR	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(1.615.336)**	**(4,75)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**31.770.573**	**93,37**
Sonstiges Nettovermögen	**2.256.254**	**6,63**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**34.026.827**	**100,00**

Portfolioanalyse		EUR	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	30.274.800	83,76
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	2.898.241	8,02
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(254.796)	(0,70)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(1.147.672)	(3,18)
Anlagen insgesamt		**31.770.573**	**87,90**

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Netto-vermögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,59 % (31. Dezember 2022: 0,66 %)				
	Euro				
400.000	Blackrock European CLO XIV DAC Series 14X Class E	11,61 %	15.07.2036	398.391	0,10
500.000	Contego CLO XII DAC Series 12X Class E	11,97 %	25.01.2038	499.043	0,12
300.000	CVC Cordatus Loan Fund XXVII DAC Series 27X Class F	14,32 %	15.04.2035	303.643	0,08
300.000	Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E	11,05 %	15.05.2035	292.664	0,07
375.000	RRE 5 Loan Management DAC Series 5X Class DR	10,29 %	15.01.2037	364.666	0,09
350.000	Vesey Park CLO DAC Series 1X Class E	13,88 %	16.11.2032	341.694	0,08
	Euro insgesamt			**2.200.101**	**0,54**
	US-Dollar				
250.000	Flatiron CLO 17 Ltd Series 2017-1X Class ER	11,54 %	15.05.2030	225.240	0,05
	US-Dollar insgesamt			**225.240**	**0,05**
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **			**2.425.341**	**0,59**
	Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %)				
	Euro				
4.500.000	Abertis Infraestructuras Finance BV*	3,25 %	29.12.2049	4.330.836	1,06
1.400.000	Accor SA*	7,25 %	29.12.2049	1.526.657	0,37
1.100.000	Adevinta ASA*	3,00 %	15.11.2027	1.097.140	0,27
1.620.000	Afflelou SAS*	4,25 %	19.05.2026	1.617.975	0,40
1.595.000	Altice Financing SA*	2,25 %	15.01.2025	1.553.227	0,38
3.425.000	Altice Financing SA**	4,25 %	15.08.2029	3.049.106	0,75
1.829.000	Altice France Holding SA*	4,00 %	15.02.2028	817.481	0,20
950.000	Altice France Holding SA*	8,00 %	15.05.2027	548.371	0,13
980.000	Altice France SA**	2,13 %	15.02.2025	947.679	0,23
150.000	Altice France SA*	3,38 %	15.01.2028	119.457	0,03
3.665.000	Altice France SA**	4,13 %	15.01.2029	2.940.136	0,72
1.000.000	Altice France SA*	5,88 %	01.02.2027	894.865	0,22
1.418.000	Aramark International Finance Sarl*	3,13 %	01.04.2025	1.414.855	0,35
1.655.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc*	3,00 %	01.09.2029	1.339.324	0,33
1.875.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	2,13 %	15.08.2026	1.676.917	0,41
995.000	Arena Luxembourg Finance Sarl*	1,88 %	01.02.2028	892.209	0,22
1.745.000	Ashland Services BV**	2,00 %	30.01.2028	1.626.106	0,40
1.996.000	Assemblin Group AB**	8,96 %	05.07.2029	2.030.690	0,50
2.370.000	Avantor Funding Inc*	3,88 %	15.07.2028	2.326.819	0,57
3.172.000	Avis Budget Finance Plc**	7,25 %	31.07.2030	3.404.971	0,83
620.000	Balder Finland OYJ*	2,00 %	18.01.2031	455.278	0,11
2.117.000	Banijay Entertainment SASU**	7,00 %	01.05.2029	2.238.816	0,55
993.000	Banijay Group SAS**	6,50 %	01.03.2026	994.534	0,24
2.800.000	Bayer AG*	5,38 %	25.03.2082	2.666.460	0,65

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
2.000.000	Bayer AG*	7,00 %	25.09.2083	2.069.682	0,51
1.600.000	BCP V Modular Services Finance II Plc**	4,75 %	30.11.2028	1.490.594	0,37
1.008.000	BCP V Modular Services Finance Plc**	6,75 %	30.11.2029	831.746	0,20
1.775.000	Belden Inc*	3,38 %	15.07.2031	1.570.170	0,38
1.306.000	Belden Inc*	3,88 %	15.03.2028	1.271.144	0,31
1.494.000	Benteler International AG*	9,38 %	15.05.2028	1.599.736	0,39
3.567.000	Birkenstock Financing Sarl*	5,25 %	30.04.2029	3.558.404	0,87
1.228.000	Boels Topholding BV**	6,25 %	15.02.2029	1.286.382	0,32
1.745.000	Canpack SA/Canpack US LLC*	2,38 %	01.11.2027	1.604.021	0,39
1.210.000	Castle UK Finco Plc**	9,25 %	15.05.2028	1.123.757	0,28
4.200.000	CECONOMY AG*	1,75 %	24.06.2026	3.661.405	0,90
1.400.000	Cellnex Finance Co SA*	1,50 %	08.06.2028	1.285.367	0,31
5.200.000	Cellnex Telecom SA*	1,75 %	23.10.2030	4.568.850	1,12
1.550.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH**	4,38 %	15.01.2028	1.515.272	0,37
2.043.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH*	7,50 %	15.05.2030	2.181.744	0,53
2.455.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	4,38 %	15.05.2026	2.442.637	0,60
1.152.000	Constellium SE*	3,13 %	15.07.2029	1.062.720	0,26
740.000	Constellium SE*	4,25 %	15.02.2026	738.432	0,18
900.000	Coty Inc**	3,88 %	15.04.2026	900.494	0,22
461.000	Coty Inc**	5,75 %	15.09.2028	486.712	0,12
2.495.000	CPI Property Group SA*	1,75 %	14.01.2030	1.425.995	0,35
2.680.000	Ctec II GmbH**	5,25 %	15.02.2030	2.408.650	0,59
1.270.000	Cullinan Holdco Scsp**	4,63 %	15.10.2026	992.759	0,24
3.325.000	Dana Financing Luxembourg Sarl*	8,50 %	15.07.2031	3.648.373	0,89
2.000.000	Deutsche Lufthansa AG*	3,50 %	14.07.2029	1.952.258	0,48
2.500.000	Deutsche Lufthansa AG*	3,75 %	11.02.2028	2.472.905	0,61
5.945.000	Douglas GmbH*	6,00 %	08.04.2026	5.892.595	1,44
4.600.000	EDP - Energias de Portugal SA*	5,94 %	23.04.2083	4.784.138	1,17
605.000	eircom Finance DAC**	2,63 %	15.02.2027	570.730	0,14
4.200.000	Electricite de France SA*	2,63 %	29.12.2049	3.746.358	0,92
1.600.000	Electricite de France SA*	4,00 %	29.12.2049	1.590.306	0,39
1.800.000	Electricite de France SA*	5,00 %	29.12.2049	1.801.269	0,44
3.200.000	Electricite de France SA*	7,50 %	29.12.2049	3.501.466	0,86
1.465.000	Elior Group SA*	3,75 %	15.07.2026	1.358.919	0,33
654.000	Emerald Debt Merger Sub LLC**	6,38 %	15.12.2030	701.350	0,17
664.000	Emeria SASU**	3,38 %	31.03.2028	572.069	0,14
810.000	Emeria SASU**	7,75 %	31.03.2028	787.016	0,19
3.110.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50 %	30.06.2029	2.691.146	0,66
2.028.000	Ephios Subco 3 Sarl**	7,88 %	31.01.2031	2.102.610	0,52

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
2.654.000	Eroski S Coop*	10,63 %	30.04.2029	2.741.075	0,67
2.100.000	Fastighets AB Balder*	2,87 %	02.06.2081	1.590.355	0,39
1.140.000	Fiber Bidco SpA*	9,89 %	25.10.2027	1.161.649	0,28
1.515.000	Fiber Bidco SpA*	11,00 %	25.10.2027	1.658.925	0,41
1.200.000	Food Service Project SA*	5,50 %	21.01.2027	1.202.538	0,29
1.200.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,02 %	06.03.2024	1.196.588	0,29
710.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,87 %	03.08.2027	730.804	0,18
500.000	Forvia SE*	3,13 %	15.06.2026	491.512	0,12
1.525.000	Forvia SE*	3,75 %	15.06.2028	1.498.291	0,37
3.265.000	Forvia SE*	7,25 %	15.06.2026	3.469.291	0,85
1.295.000	Grifols SA*	1,63 %	15.02.2025	1.269.691	0,31
1.055.000	Grifols SA*	3,20 %	01.05.2025	1.035.117	0,25
2.070.000	Grifols SA*	3,88 %	15.10.2028	1.896.557	0,46
740.000	Gruenenthal GmbH*	3,63 %	15.11.2026	732.230	0,18
700.000	Gruenenthal GmbH**	4,13 %	15.05.2028	694.409	0,17
150.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,38 %	30.04.2026	133.331	0,03
2.235.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,50 %	30.04.2028	1.708.356	0,42
2.071.000	Guala Closures SpA*	3,25 %	15.06.2028	1.954.506	0,48
900.000	Heimstaden Bostad AB*	3,00 %	29.12.2049	316.449	0,08
1.760.000	Heimstaden Bostad AB*	3,25 %	29.12.2049	922.680	0,23
440.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	0,75 %	06.09.2029	290.813	0,07
200.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	1,38 %	24.07.2028	144.144	0,04
1.350.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	1,63 %	13.10.2031	856.632	0,21
1.320.000	House of HR Group BV**	9,00 %	03.11.2029	1.376.029	0,34
860.000	IHO Verwaltungs GmbH*	3,75 %	15.09.2026	850.337	0,21
1.200.000	IHO Verwaltungs GmbH*	3,88 %	15.05.2027	1.178.531	0,29
3.249.000	IHO Verwaltungs GmbH*	8,75 %	15.05.2028	3.547.388	0,87
3.560.000	Iliad Holding SASU**	5,13 %	15.10.2026	3.559.694	0,87
810.000	Iliad Holding SASU**	5,63 %	15.10.2028	815.420	0,20
200.000	iliad SA*	5,38 %	14.06.2027	205.917	0,05
3.613.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc*	3,75 %	15.07.2026	3.498.042	0,86
1.192.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc*	8,50 %	15.03.2029	1.261.529	0,31
1.000.000	Infineon Technologies AG*	2,88 %	29.12.2049	978.465	0,24
700.000	Infineon Technologies AG*	3,63 %	29.12.2049	673.892	0,17
2.700.000	International Consolidated Airlines Group SA*	3,75 %	25.03.2029	2.625.264	0,64
203.233	Intrum AB*	3,13 %	15.07.2024	199.852	0,05
597.000	IPD 3 BV*	8,00 %	15.06.2028	639.068	0,16
900.000	IQVIA Inc**	2,88 %	15.06.2028	860.418	0,21
1.000.000	Italmatch Chemicals SpA*	10,00 %	06.02.2028	1.036.180	0,25
3.295.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50 %	15.07.2028	3.227.700	0,79

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
770.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	6,88 %	15.11.2026	824.476	0,20
1.170.000	Kaixo Bondco Telecom SA*	5,13 %	30.09.2029	1.099.800	0,27
1.756.000	Kapla Holding SAS*	3,38 %	15.12.2026	1.705.060	0,42
526.000	Kapla Holding SAS*	9,47 %	15.07.2027	537.243	0,13
2.470.000	Koninklijke KPN NV*	6,00 %	29.12.2049	2.564.725	0,63
860.000	Kronos International Inc**	3,75 %	15.09.2025	826.998	0,20
1.525.000	Lion/Polaris Lux 4 SA*	7,93 %	01.07.2026	1.525.907	0,37
6.925.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	6.777.809	1,66
2.202.000	Loxam SAS*	5,75 %	15.07.2027	2.175.686	0,53
648.000	Loxam SAS*	6,38 %	15.05.2028	676.447	0,17
1.700.000	Loxam SAS*	6,38 %	31.05.2029	1.765.399	0,43
1.620.000	Lune Holdings Sarl**	5,63 %	15.11.2028	1.327.086	0,33
1.055.000	Matterhorn Telecom SA**	3,13 %	15.09.2026	1.024.006	0,25
1.662.000	Monitchem HoldCo 3 SA*	8,75 %	01.05.2028	1.702.172	0,42
3.025.000	Mooney Group SpA**	7,81 %	17.12.2026	2.981.588	0,73
3.227.000	Motion Finco Sarl*	7,38 %	15.06.2030	3.306.649	0,81
3.556.000	Multiversity SRL*	8,20 %	30.10.2028	3.576.358	0,88
1.310.000	Nidda BondCo GmbH**	5,00 %	30.09.2025	1.300.725	0,32
3.090.000	Nidda Healthcare Holding GmbH**	7,50 %	21.08.2026	3.190.382	0,78
1.410.000	Nobian Finance BV*	3,63 %	15.07.2026	1.358.887	0,33
400.000	Olympus Water US Holding Corp*	3,88 %	01.10.2028	367.760	0,09
100.000	Olympus Water US Holding Corp*	5,38 %	01.10.2029	85.837	0,02
1.930.000	Olympus Water US Holding Corp*	9,63 %	15.11.2028	2.074.634	0,51
640.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV*	2,88 %	30.04.2028	589.500	0,14
417.000	Paprec Holding SA**	6,50 %	17.11.2027	446.650	0,11
1.176.000	PCF GmbH*	4,75 %	15.04.2026	862.798	0,21
2.315.000	PEU Finance Plc*	7,25 %	01.07.2028	2.388.730	0,59
1.340.000	Piaggio & C SpA*	6,50 %	05.10.2030	1.417.461	0,35
150.000	Picard Bondco SA*	5,38 %	01.07.2027	141.352	0,03
2.120.000	Picard Groupe SAS*	3,88 %	01.07.2026	2.071.106	0,51
1.720.000	PLT VII Finance Sarl**	4,63 %	05.01.2026	1.714.659	0,42
1.600.000	PrestigeBidCo GmbH**	9,97 %	15.07.2027	1.628.982	0,40
2.445.000	Primo Water Holdings Inc**	3,88 %	31.10.2028	2.365.797	0,58
2.405.000	Q-Park Holding I BV**	1,50 %	01.03.2025	2.362.215	0,58
1.200.000	RCS & RDS SA*	2,50 %	05.02.2025	1.177.552	0,29
100.000	RCS & RDS SA*	3,25 %	05.02.2028	89.626	0,02
700.000	Rossini Sarl*	6,75 %	30.10.2025	702.218	0,17
760.000	Rossini Sarl*	7,83 %	30.10.2025	763.800	0,19
1.100.000	Schaeffler AG*	3,38 %	12.10.2028	1.068.345	0,26
2.605.000	SES SA*	2,88 %	29.12.2049	2.376.104	0,58

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
1.850.000	SES SA*	5,63 %	29.12.2049	1.853.219	0,45
845.000	Sigma Holdco BV**	5,75 %	15.05.2026	760.677	0,19
850.000	SNF Group SACA*	2,63 %	01.02.2029	783.419	0,19
180.211	Summer BC Holdco A Sarl**	9,25 %	31.10.2027	161.794	0,04
1.420.000	Summer BC Holdco B Sarl**	5,75 %	31.10.2026	1.364.715	0,33
1.672.000	Summit Properties Ltd*	2,00 %	31.01.2025	1.576.069	0,39
1.210.000	Synthomer Plc*	3,88 %	01.07.2025	1.199.848	0,29
3.450.852	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**	6,00 %	30.07.2026	3.453.612	0,85
1.650.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**	2,00 %	15.07.2025	1.618.142	0,40
110.000	Telecom Italia Finance SA*	7,75 %	24.01.2033	128.618	0,03
2.165.000	Telecom Italia SpA**	1,63 %	18.01.2029	1.877.185	0,46
1.110.000	Telecom Italia SpA*	2,38 %	12.10.2027	1.040.400	0,25
800.000	Telecom Italia SpA*	2,88 %	28.01.2026	776.132	0,19
200.000	Telecom Italia SpA**	3,00 %	30.09.2025	195.666	0,05
3.770.000	Telecom Italia SpA**	4,00 %	11.04.2024	3.761.476	0,92
4.667.000	Telecom Italia SpA*	7,88 %	31.07.2028	5.197.638	1,27
1.500.000	Telefonica Europe BV*	2,88 %	29.12.2049	1.400.292	0,34
200.000	Telefonica Europe BV*	3,88 %	29.12.2049	194.044	0,05
1.900.000	Telefonica Europe BV*	4,38 %	29.12.2049	1.889.664	0,46
2.100.000	Telefonica Europe BV*	6,14 %	29.12.2049	2.164.460	0,53
2.300.000	Telefonica Europe BV*	6,75 %	29.12.2049	2.461.545	0,60
198.000	Tendam Brands SAU*	11,45 %	31.03.2028	201.589	0,05
1.475.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,63 %	15.10.2028	1.261.178	0,31
2.100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	4,38 %	09.05.2030	1.977.181	0,48
1.330.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	4,50 %	01.03.2025	1.332.660	0,33
1.230.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	6,00 %	31.01.2025	1.244.850	0,30
2.830.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	7,38 %	15.09.2029	3.104.485	0,76
702.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	7,88 %	15.09.2031	797.559	0,20
1.683.000	Titan Holdings II BV*	5,13 %	15.07.2029	1.447.380	0,35
2.088.000	TK Elevator Holdco GmbH**	6,63 %	15.07.2028	1.934.342	0,47
1.725.000	TK Elevator Midco GmbH**	4,38 %	15.07.2027	1.673.595	0,41
350.000	TK Elevator Midco GmbH**	8,72 %	15.07.2027	355.950	0,09
700.000	TMNL Holding BV**	3,75 %	15.01.2029	666.383	0,16
1.415.000	Trivium Packaging Finance BV*	3,75 %	15.08.2026	1.374.743	0,34
4.120.000	UGI International LLC**	2,50 %	01.12.2029	3.518.711	0,86
600.000	United Group BV**	3,13 %	15.02.2026	576.726	0,14
800.000	United Group BV*	4,00 %	15.11.2027	759.646	0,19
1.700.000	United Group BV**	5,25 %	01.02.2030	1.615.901	0,40
750.000	UPC Holding BV*	3,88 %	15.06.2029	697.694	0,17
1.060.000	UPCB Finance VII Ltd*	3,63 %	15.06.2029	1.016.049	0,25

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
200.000	Valeo SE*	1,00 %	03.08.2028	175.658	0,04
2.800.000	Valeo SE*	5,38 %	28.05.2027	2.913.078	0,71
900.000	Valeo SE*	5,88 %	12.04.2029	967.447	0,24
600.000	Veolia Environnement SA*	2,25 %	29.12.2049	568.115	0,14
1.000.000	Veolia Environnement SA*	2,50 %	29.12.2049	897.567	0,22
1.700.000	Verisure Holding AB*	3,25 %	15.02.2027	1.636.701	0,40
2.385.000	Verisure Holding AB*	3,88 %	15.07.2026	2.347.567	0,57
2.676.000	Verisure Midholding AB*	5,25 %	15.02.2029	2.562.297	0,63
500.000	Virgin Media Finance Plc**	3,75 %	15.07.2030	460.625	0,11
400.000	Vodafone Group Plc*	2,63 %	27.08.2080	381.138	0,09
450.000	Vodafone Group Plc*	3,00 %	27.08.2080	403.833	0,10
2.220.000	Vodafone Group Plc*	4,20 %	03.10.2078	2.170.771	0,53
1.575.000	WEPA Hygieneprodukte GmbH**	2,88 %	15.12.2027	1.478.843	0,36
1.760.000	WMG Acquisition Corp*	2,25 %	15.08.2031	1.549.145	0,38
1.400.000	Wp/ap Telecom Holdings III BV**	5,50 %	15.01.2030	1.281.959	0,31
1.600.000	ZF Europe Finance BV*	3,00 %	23.10.2029	1.477.000	0,36
400.000	ZF Finance GmbH*	3,00 %	21.09.2025	391.708	0,10
2.500.000	ZF Finance GmbH*	3,75 %	21.09.2028	2.418.580	0,59
5.020.000	Ziggo Bond Co BV*	3,38 %	28.02.2030	4.255.228	1,04
	Euro insgesamt			**325.684.785**	**79,74**
	Britisches Pfund				
2.775.000	AA Bond Co Ltd*	6,50 %	31.01.2026	3.058.325	0,75
500.000	AA Bond Co Ltd*	8,45 %	31.01.2028	606.276	0,15
300.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	4,75 %	15.07.2027	253.410	0,06
500.000	B&M European Value Retail SA*	4,00 %	15.11.2028	539.100	0,13
1.414.000	B&M European Value Retail SA*	8,13 %	15.11.2030	1.741.742	0,43
5.750.000	Bellis Acquisition Co Plc**	3,25 %	16.02.2026	6.174.205	1,51
200.000	Bellis Finco Plc**	4,00 %	16.02.2027	201.507	0,05
2.734.000	British Telecommunications Plc*	8,38 %	20.12.2083	3.339.442	0,82
800.000	Castle UK Finco Plc**	7,00 %	15.05.2029	786.647	0,19
2.295.000	Constellation Automotive Financing Plc*	4,88 %	15.07.2027	2.185.328	0,54
2.790.000	Co-operative Group Holdings 2011 Ltd*	7,50 %	08.07.2026	3.184.313	0,78
2.440.000	CPUK Finance Ltd**	6,50 %	28.08.2026	2.729.169	0,67
500.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,54 %	06.03.2025	569.077	0,14
1.485.000	Iceland Bondco Plc**	10,88 %	15.12.2027	1.792.881	0,44
2.220.000	Iron Mountain UK Plc*	3,88 %	15.11.2025	2.473.947	0,61
1.952.000	Maison Finco Plc**	6,00 %	31.10.2027	1.953.063	0,48
3.950.000	Mobico Group Plc*	4,25 %	29.12.2049	4.036.062	0,99
1.295.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	2,50 %	24.03.2026	1.218.800	0,30

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 94,13 % (31. Dezember 2022: 98,80 %) (Fortsetzung)				
	Britisches Pfund (Fortsetzung)				
2.255.000	NGG Finance Plc*	5,63 %	18.06.2073	2.572.467	0,63
2.430.000	Pinewood Finance Co Ltd**	3,25 %	30.09.2025	2.733.408	0,67
2.869.000	Pinnacle Bidco Plc*	10,00 %	11.10.2028	3.450.568	0,84
2.060.000	RAC Bond Co Plc**	5,25 %	04.11.2027	2.085.568	0,51
886.000	Sherwood Financing Plc**	6,00 %	15.11.2026	918.690	0,22
965.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc**	8,25 %	31.07.2025	1.091.445	0,27
450.000	Travis Perkins Plc*	3,75 %	17.02.2026	490.185	0,12
1.746.000	TVL Finance Plc*	10,25 %	28.04.2028	2.099.398	0,51
1.000.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	4,25 %	15.01.2030	1.012.078	0,25
1.650.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88 %	15.07.2028	1.757.874	0,43
1.000.000	Vmed O2 UK Financing I Plc**	4,50 %	15.07.2031	1.001.105	0,25
200.000	Vodafone Group Plc*	4,88 %	03.10.2078	224.905	0,05
2.620.000	Zenith Finco Plc**	6,50 %	30.06.2027	2.467.966	0,60
	Britisches Pfund insgesamt			**58.748.951**	**14,39**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**384.433.736**	**94,13**
	Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,63 %)				
	Euro				
24.107	Aernnova Aerospace SAU	6,92 %	26.02.2027	23.414	0,01
94.016	Aernnova Aerospace SAU	6,96 %	26.02.2027	91.313	0,02
	Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †			**114.727**	**0,03**
	Anlagen insgesamt			**386.973.804**	**94,75**

Devisenterminkontrakte 0,15 % (31. Dezember 2022: 3,87 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettover-mögens
5.637.173 €	4.848.096 £	18.01.2024	UBS AG	3	45.315	0,01
278.715 €	295.155 US$	18.01.2024	UBS AG	1	11.688	0,00
141.886 €	122.899 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	132	0,00
Abgesicherte Klassen CHF						
56.000 CHF	58.593 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	1.701	0,00
1.684.836 CHF	1.777.778 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	8	36.230	0,01
Abgesicherte Klassen SGD						
576 €	611 US$	18.01.2024	UBS AG	1	23	0,00
Abgesicherte Klassen USD						
78.829 €	83.796 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	3.018	0,00
14.840.068 €	15.806.873 US$	18.01.2024	UBS AG	2	539.581	0,13
142.284 €	151.595 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	6	5.135	0,00
123.627 US$	111.578 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	268	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**643.091**	**0,15**

European High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Total Return Swap-Kontrakte 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Nominalwert		Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettovermögens
EUR	10.018.326	20.03.2024	3,90[1]	iBoxx EUR Liquid High Yield Index[2]	18.355	0,01
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten ∞					**18.355**	**0,01**

[1] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 6-Monats-EURIBOR.

[2] Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**387.635.250**	**94,91**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,31 %) (31. Dezember 2022: (9,59 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
36.318.532 €	31.552.201 £	18.01.2024	UBS AG	8	(74.191)	(0,02)
15.726.139 €	13.714.262 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	(92.073)	(0,02)
Abgesicherte Klassen CHF						
21.500 CHF	23.169 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(20)	(0,00)
10.072 €	9.528 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(187)	(0,00)
Abgesicherte Klassen USD						
944.119 US$	873.968 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	9	(19.823)	(0,00)
27.586.576 US$	25.897.601 €	18.01.2024	UBS AG	3	(940.007)	(0,23)
8.107.228 US$	7.489.766 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	13	(155.151)	(0,04)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(1.281.452)**	**(0,31)**

	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(1.281.452)**	**(0,31)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**386.353.798**	**94,60**
Sonstiges Nettovermögen	**22.062.519**	**5,40**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**408.416.317**	**100,00**

Portfolioanalyse		EUR	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	267.372.886	65,07
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	119.486.191	29,08
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	114.727	0,03
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(620.006)	(0,15)
Anlagen insgesamt		**386.353.798**	**94,03**

European Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert EUR	% des Netto-vermögens
	Aktien 99,49 % (31. Dezember 2022: 99,17 %)		
	Dänische Krone		
97.822	Netcompany Group A/S	2.960.420	1,72
112.354	Novo Nordisk A/S Class B	10.521.650	6,11
	Dänische Krone insgesamt	**13.482.070**	**7,83**
	Euro		
3.848	Adyen NV	4.489.077	2,61
59.995	Alfen NV	3.616.499	2,10
15.627	ASML Holding NV	10.652.926	6,19
28.102	Beiersdorf AG	3.813.441	2,22
13.093	DiaSorin SpA	1.220.791	0,71
26.711	EssilorLuxottica SA	4.850.718	2,82
97.285	Euronext NV	7.651.465	4,45
7.132	Ferrari NV	2.176.686	1,26
137.963	HelloFresh SE	1.974.250	1,15
15.435	Kering SA	6.158.565	3,58
17.823	L'Oreal SA	8.031.935	4,67
168.880	RELX Plc	6.049.282	3,51
26.481	Reply SpA	3.164.479	1,84
10.826	Sartorius Stedim Biotech	2.592.827	1,51
52.255	Schneider Electric SE	9.498.914	5,52
63.993	Scout24 SE	4.105.791	2,38
114.400	TeamViewer SE	1.608.464	0,93
132.644	Zalando SE	2.845.214	1,65
	Euro insgesamt	**84.501.324**	**49,10**
	Norwegische Krone		
109.904	Bakkafrost P/F	5.211.834	3,03
	Norwegische Krone insgesamt	**5.211.834**	**3,03**
	Britisches Pfund		
367.495	3i Group Plc	10.267.473	5,97
297.157	CVS Group Plc	5.771.483	3,35
77.173	London Stock Exchange Group Plc	8.259.425	4,80
	Britisches Pfund insgesamt	**24.298.381**	**14,12**
	Schwedische Krone		
248.717	Assa Abloy AB Class B	6.485.746	3,77
257.416	Atlas Copco AB Class A	4.012.985	2,33
	Schwedische Krone insgesamt	**10.498.731**	**6,10**

European Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
	Aktien 99,49 % (31. Dezember 2022: 99,17 %) (Fortsetzung)		
	Schweizer Franken		
85.327	Nestle SA	8.949.101	5,20
5.949	Partners Group Holding AG	7.761.551	4,51
36.320	Straumann Holding AG	5.297.236	3,08
10.797	Tecan Group AG	3.987.926	2,32
11.135	VAT Group AG	5.048.142	2,93
	Schweizer Franken insgesamt	**31.043.956**	**18,04**
	US-Dollar		
25.840	SolarEdge Technologies Inc	2.189.494	1,27
	US-Dollar insgesamt	**2.189.494**	**1,27**
	Aktien insgesamt *	**171.225.790**	**99,49**
	Anlagen insgesamt	**171.225.790**	**99,49**
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		**171.225.790**	**99,49**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto		**171.225.790**	**99,49**
Sonstiges Nettovermögen		**871.761**	**0,51**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		**172.097.551**	**100,00**

Portfolioanalyse	EUR	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	171.225.790	98,69
Anlagen insgesamt	**171.225.790**	**98,69**

Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Schatzwechsel 91,00 % (31. Dezember 2022: 81,61 %)				
	US-Dollar				
7.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	04.01.2024	6.997.968	5,54
3.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	09.01.2024	2.996.944	2,37
7.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	11.01.2024	6.990.862	5,53
3.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	16.01.2024	2.993.872	2,37
7.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	18.01.2024	6.983.585	5,52
7.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	25.01.2024	6.976.441	5,52
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	01.02.2024	4.978.049	3,94
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	08.02.2024	4.972.947	3,93
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	15.02.2024	4.968.002	3,93
6.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	22.02.2024	5.955.440	4,71
6.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	29.02.2024	5.949.161	4,71
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	07.03.2024	4.953.044	3,92
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	14.03.2024	4.948.165	3,91
6.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	19.03.2024	5.933.334	4,69
6.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	21.03.2024	5.931.708	4,69
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	28.03.2024	4.937.987	3,91
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	04.04.2024	4.932.898	3,90
7.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	11.04.2024	6.899.258	5,46
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	16.04.2024	4.924.118	3,90
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	23.04.2024	4.919.215	3,89
6.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	30.04.2024	5.896.721	4,66
	Schatzwechsel insgesamt **			**115.039.719**	**91,00**
	Anlagen insgesamt			**115.039.719**	**91,00**

Devisenterminkontrakte 3,21 % (31. Dezember 2022: 2,21 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
9.462 €	10.078 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	4	380	0,00
307 €	336 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	3	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
79.786.994 £	97.968.962 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	3.752.417	2,97
16.000.327 £	20.099.048 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	62	299.957	0,24
4.596.271 US$	3.601.100 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	5.186	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**4.057.943**	**3,21**

Event Driven - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Total Return Swap-Kontrakte 0,76 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)

	Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettovermögens
USD	103.060.180	28.10.2024	0,25[1]	Alphas Managed Accounts Platform CXIV Limited[2]	959.529	0,76
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten ∞					**959.529**	**0,76**

[1] Fester Zinssatz.

[2] Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**120.057.191**	**94,97**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,12 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
Abgesicherte Klassen EUR						
237 US$	219 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(6)	(0,00)
Abgesicherte Klassen GBP						
216.997 £	276.907 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(255)	(0,00)
5.179.066 US$	4.183.952 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	34	(155.104)	(0,12)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(155.365)**	**(0,12)**

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(155.365)**	**(0,12)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**119.901.826**	**94,85**
Sonstiges Nettovermögen	**6.510.322**	**5,15**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**126.412.148**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtvermögens
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	115.039.719	85,84
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	4.862.107	3,63
Anlagen insgesamt		**119.901.826**	**89,47**

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Agency Bonds 1,05 % (31. Dezember 2022: 1,80 %)				
	US-Dollar				
395.000	Federal Home Loan Banks*	5,50 %	15.07.2036	446.745	0,41
185.000	Federal National Mortgage Association**	0,50 %	07.11.2025	172.350	0,16
165.000	Federal National Mortgage Association**	0,75 %	08.10.2027	146.541	0,13
390.000	Federal National Mortgage Association**	0,88 %	05.08.2030	318.020	0,29
55.000	Tennessee Valley Authority*	5,88 %	01.04.2036	62.882	0,06
	Agency Bonds insgesamt			**1.146.538**	**1,05**
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 9,99 % (31. Dezember 2022: 6,57 %)				
	Euro				
580.425	Clavel Residential 3 DAC Series 2023-1X Class A	5,33 %	28.01.2076	637.913	0,59
88.190	Dutch Property Finance BV Series 2022-2 Class A	4,83 %	28.04.2062	97.398	0,09
105.949	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	6,88 %	24.02.2058	116.248	0,11
399.918	Last Mile Securities - PE 2021 DAC Series 2021-1X Class A2	5,04 %	17.08.2031	430.110	0,39
182.575	Primrose Residental 2021-1 DAC Series 2021-1 Class A	4,61 %	24.03.2061	201.804	0,18
94.104	Red & Black Auto Italy SRL	4,87 %	28.07.2034	104.394	0,10
600.000	Shamrock Residential 2022-1 DAC Series 2022-1 Class C	5,76 %	24.01.2061	647.933	0,60
278.389	Shamrock Residential 2023-1 DAC Series 2023-1X Class A	4,86 %	24.06.2071	306.842	0,28
400.000	Stresa Securitisation SRL	5,17 %	22.12.2045	428.392	0,39
	Euro insgesamt			**2.971.034**	**2,73**
	Britisches Pfund				
120.000	Mortimer BTL 2021-1 Plc Series 2021-1 Class C	6,67 %	23.06.2053	149.363	0,14
407.071	Parkmore Point RMBS 2022-1 Plc Series 2022-1X Class A	6,72 %	25.07.2045	520.663	0,48
	Britisches Pfund insgesamt			**670.026**	**0,62**
	US-Dollar				
865.496	CD 2017-CD6 Mortgage Trust Class ASB	3,33 %	13.11.2050	834.028	0,77
975.026	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 Class XA	1,30 %	10.02.2048	8.840	0,01
305.000	COMM 2014-CCRE15 Mortgage Trust Class AM	4,43 %	10.02.2047	297.245	0,27
1.614.731	COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust Class XA	0,87 %	10.05.2047	221	0,00
896.744	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust Class XA	0,00 %	10.04.2047	58	0,00
1.523.497	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA	1,04 %	10.06.2047	321	0,00
586.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1M2	7,24 %	25.12.2041	587.831	0,54
2.323.044	CSAIL 2015-C2 Commercial Mortgage Trust Class XA	0,71 %	15.06.2057	13.250	0,01
505.000	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust Class A4	4,22 %	15.08.2051	480.760	0,44
207.364	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	9,80 %	25.05.2029	218.858	0,20
522.591	Fannie Mae REMICS Class HS	0,55 %	25.07.2042	69.593	0,06
331.166	Fannie Mae REMICS Class PI	3,50 %	25.12.2042	51.541	0,05
591.284	Fannie Mae REMICS Class SA	0,40 %	25.07.2046	67.693	0,06

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 9,99 % (31. Dezember 2022: 6,57 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
570.456	Freddie Mac REMICS Class HS	1,00 %	15.03.2042	78.028	0,07
561.799	Freddie Mac REMICS Class SA	0,60 %	15.04.2046	68.219	0,06
545.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 Class M2	7,84 %	25.01.2042	545.065	0,50
550.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3 Class M1B	8,24 %	25.04.2042	565.832	0,52
578.180	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1A	7,44 %	25.03.2042	582.806	0,54
550.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1B	8,84 %	25.03.2042	570.448	0,52
357.622	Freddie Mac Strips Class S1	0,50 %	15.09.2043	43.411	0,04
446.765	Government National Mortgage Association Class AB	1,00 %	20.07.2050	342.633	0,32
951.856	Government National Mortgage Association Class AI	2,00 %	20.02.2051	113.793	0,10
335.968	Government National Mortgage Association Class HE	2,00 %	20.06.2051	278.999	0,26
482.373	Government National Mortgage Association Class IT	3,50 %	20.02.2043	70.732	0,07
362.044	Government National Mortgage Association Class KA	1,00 %	20.08.2050	277.281	0,26
319.128	Government National Mortgage Association Class NC	1,50 %	20.07.2051	261.168	0,24
317.466	Government National Mortgage Association Class WK	1,00 %	20.06.2050	243.144	0,22
112.214	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 Class XA	0,81 %	10.01.2047	6	0,00
2.520.327	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA	0,72 %	10.05.2050	17.508	0,02
109.000	JP Morgan Mortgage Trust 2023-HE3 Class A1	6,94 %	25.05.2054	109.273	0,10
160.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C	4,28 %	15.06.2050	133.722	0,12
286.875	Taco Bell Funding LLC Class A23	4,97 %	25.05.2046	283.402	0,26
1.607.947	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA	0,98 %	15.08.2047	7.737	0,01
	US-Dollar insgesamt			**7.223.446**	**6,64**
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **			**10.864.506**	**9,99**
	Unternehmensanleihen 26,54 % (31. Dezember 2022: 32,90 %)				
	Dänische Krone				
7.028.062	Nykredit Realkredit AS*	4,00 %	01.10.2053	1.030.253	0,95
	Dänische Krone insgesamt			**1.030.253**	**0,95**
	Euro				
100.000	American Tower Corp*	4,13 %	16.05.2027	112.923	0,10
135.000	AT&T Inc*	2,40 %	15.03.2024	148.623	0,14
100.000	AT&T Inc*	2,45 %	15.03.2035	98.559	0,09
306.000	Athene Global Funding*	0,37 %	10.09.2026	309.829	0,28
130.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd*	5,10 %	03.02.2033	147.815	0,14
100.000	Bayerische Landesbank*	7,00 %	05.01.2034	114.630	0,10
200.000	BNP Paribas Home Loan SFH SA*	3,00 %	25.05.2028	223.834	0,21
100.000	BPCE SA*	5,75 %	01.06.2033	116.933	0,11
200.000	BPCE SFH SA*	3,25 %	12.04.2028	225.043	0,21
100.000	BUPA Finance Plc*	5,00 %	12.10.2030	118.891	0,11

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,54 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
300.000	Canadian Imperial Bank of Commerce*	3,25 %	31.03.2027	334.503	0,31
200.000	Carmila SA*	5,50 %	09.10.2028	229.326	0,21
307.000	Digital Dutch Finco BV*	1,00 %	15.01.2032	270.729	0,25
135.000	Exxon Mobil Corp*	1,41 %	26.06.2039	110.859	0,10
200.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec*	3,25 %	18.04.2028	223.925	0,21
195.000	Global Payments Inc*	4,88 %	17.03.2031	226.685	0,21
210.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	0,63 %	24.07.2025	206.204	0,19
150.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	1,38 %	24.07.2028	119.401	0,11
100.000	Imerys SA*	4,75 %	29.11.2029	112.361	0,10
100.000	JPMorgan Chase & Co*	4,46 %	13.11.2031	116.541	0,11
100.000	Linde Plc*	3,63 %	12.06.2034	115.899	0,11
100.000	Medtronic Global Holdings SCA*	1,38 %	15.10.2040	81.322	0,07
145.000	Metropolitan Life Global Funding I*	4,00 %	05.04.2028	165.405	0,15
150.000	Molson Coors Beverage Co*	1,25 %	15.07.2024	163.256	0,15
185.000	Morgan Stanley*	5,15 %	25.01.2034	225.049	0,21
100.000	National Grid North America Inc*	4,67 %	12.09.2033	118.084	0,11
153.000	Nordea Bank Abp*	0,63 %	18.08.2031	155.512	0,14
100.000	RWE AG*	4,13 %	13.02.2035	115.011	0,10
100.000	Sandoz Finance BV*	4,50 %	17.11.2033	117.380	0,11
400.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd*	4,09 %	19.04.2028	457.992	0,42
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc*	4,38 %	18.01.2031	104.783	0,10
380.000	UBS Group AG*	4,38 %	11.01.2031	434.023	0,40
100.000	Upjohn Finance BV*	1,91 %	23.06.2032	93.220	0,08
100.000	Vonovia SE*	0,75 %	01.09.2032	84.102	0,08
200.000	Westpac Securities NZ Ltd*	3,75 %	20.04.2028	227.708	0,21
	Euro insgesamt			**6.226.360**	**5,73**
	Britisches Pfund				
60.000	Anglo American Capital Plc*	3,38 %	11.03.2029	70.644	0,07
113.000	Barclays Plc*	7,09 %	06.11.2029	153.576	0,14
100.000	BNP Paribas SA*	5,75 %	13.06.2032	134.696	0,12
100.000	British Telecommunications Plc*	5,75 %	13.02.2041	131.791	0,12
200.000	Coventry Building Society*	7,00 %	07.11.2027	265.679	0,24
200.000	ING Groep NV*	6,25 %	20.05.2033	257.227	0,24
100.000	Lloyds Banking Group Plc*	6,63 %	02.06.2033	130.410	0,12
100.000	Orsted AS*	5,13 %	13.09.2034	127.152	0,12
200.000	Pension Insurance Corp Plc*	8,00 %	13.11.2033	273.623	0,25
100.000	Volkswagen Financial Services NV*	6,50 %	18.09.2027	133.353	0,12
	Britisches Pfund insgesamt			**1.678.151**	**1,54**

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,54 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar				
610.000	AbbVie Inc*	2,95 %	21.11.2026	585.113	0,54
58.000	AbbVie Inc*	4,05 %	21.11.2039	52.402	0,05
130.000	American Express Co**	6,49 %	30.10.2031	141.055	0,13
225.000	Amgen Inc**	5,75 %	02.03.2063	236.340	0,22
141.000	Analog Devices Inc**	2,10 %	01.10.2031	120.071	0,11
180.000	Anheuser-Busch Cos LLC/Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	4,70 %	01.02.2036	179.515	0,17
225.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	5,45 %	23.01.2039	237.457	0,22
110.000	Apple Inc**	3,35 %	09.02.2027	107.218	0,10
425.000	Asian Development Bank*	4,50 %	25.08.2028	433.791	0,40
370.000	AT&T Inc**	3,50 %	15.09.2053	268.816	0,25
200.000	Banco Santander SA*	6,92 %	08.08.2033	213.337	0,20
210.000	Bank of America Corp**	1,84 %	04.02.2025	209.198	0,19
440.000	Bank of America Corp**	1,92 %	24.10.2031	357.445	0,33
175.000	Bank of America Corp**	2,30 %	21.07.2032	142.962	0,13
189.000	Boeing Co*	5,04 %	01.05.2027	190.751	0,18
65.000	Boeing Co*	5,71 %	01.05.2040	67.273	0,06
315.000	Boeing Co*	5,81 %	01.05.2050	326.419	0,30
130.000	BP Capital Markets America Inc*	4,81 %	13.02.2033	131.126	0,12
27.000	Broadcom Inc**	3,15 %	15.11.2025	26.161	0,02
95.000	Capital One Financial Corp**	7,62 %	30.10.2031	104.484	0,10
220.000	CDW LLC/CDW Finance Corp**	2,67 %	01.12.2026	206.039	0,19
185.000	CDW LLC/CDW Finance Corp**	4,25 %	01.04.2028	177.333	0,16
215.000	Charles Schwab Corp**	6,14 %	24.08.2034	226.709	0,21
250.000	Citigroup Inc**	3,35 %	24.04.2025	248.142	0,23
100.000	Citigroup Inc**	3,89 %	10.01.2028	96.755	0,09
125.000	Comcast Corp**	2,35 %	15.01.2027	117.393	0,11
260.000	Comcast Corp**	5,35 %	15.05.2053	269.177	0,25
100.000	ConocoPhillips Co*	5,55 %	15.03.2054	106.266	0,10
305.000	Constellation Brands Inc*	4,90 %	01.05.2033	307.045	0,28
210.000	Corebridge Financial Inc*	5,75 %	15.01.2034	214.813	0,20
395.000	Corp Andina de Fomento*	2,25 %	08.02.2027	362.027	0,33
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	5,95 %	08.01.2034	203.274	0,19
65.000	Crown Castle Inc*	1,05 %	15.07.2026	58.680	0,05
130.000	CVS Health Corp*	3,00 %	15.08.2026	124.272	0,11
145.000	CVS Health Corp*	4,78 %	25.03.2038	137.462	0,13
230.000	CVS Health Corp*	5,30 %	01.06.2033	236.127	0,22
115.000	DTE Energy Co*	1,05 %	01.06.2025	108.460	0,10
50.000	Evergy Inc**	2,45 %	15.09.2024	48.889	0,04
310.000	Exelon Corp**	5,30 %	15.03.2033	316.626	0,29

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,54 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
130.000	Exxon Mobil Corp*	3,10 %	16.08.2049	96.601	0,09
255.000	Fifth Third Bancorp**	4,34 %	25.04.2033	237.218	0,22
150.000	General Motors Co*	6,80 %	01.10.2027	159.107	0,15
410.000	Goldman Sachs Group Inc**	1,76 %	24.01.2025	408.589	0,38
370.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,27 %	29.09.2025	363.785	0,33
60.000	Ingersoll Rand Inc*	5,40 %	14.08.2028	61.868	0,06
60.000	Ingersoll Rand Inc*	5,70 %	14.08.2033	63.509	0,06
180.000	Intel Corp**	5,70 %	10.02.2053	194.787	0,18
130.000	Intel Corp**	5,90 %	10.02.2063	145.071	0,13
825.000	Inter-American Development Bank*	1,13 %	13.01.2031	680.333	0,63
195.000	Inter-American Development Bank*	4,50 %	15.05.2026	196.281	0,18
235.000	Inter-American Development Bank*	4,50 %	13.09.2033	242.608	0,22
85.000	Interstate Power & Light Co**	2,30 %	01.06.2030	72.824	0,07
655.000	JPMorgan Chase & Co**	3,22 %	01.03.2025	652.386	0,60
190.000	JPMorgan Chase & Co**	6,25 %	23.10.2034	206.068	0,19
200.000	Lloyds Banking Group Plc*	4,98 %	11.08.2033	194.939	0,18
445.000	Marathon Petroleum Corp**	4,70 %	01.05.2025	442.351	0,41
65.000	Marvell Technology Inc**	2,95 %	15.04.2031	56.833	0,05
175.000	Marvell Technology Inc**	5,95 %	15.09.2033	185.705	0,17
330.000	McDonald's Corp*	5,45 %	14.08.2053	351.449	0,32
50.000	Merck & Co Inc*	3,90 %	07.03.2039	45.507	0,04
120.000	Mohawk Industries Inc*	5,85 %	18.09.2028	124.502	0,11
350.000	Molson Coors Beverage Co*	4,20 %	15.07.2046	298.754	0,27
150.000	Morgan Stanley**	2,72 %	22.07.2025	147.545	0,14
170.000	Morgan Stanley*	3,63 %	20.01.2027	164.908	0,15
255.000	Morgan Stanley**	5,25 %	21.04.2034	255.094	0,23
210.000	Morgan Stanley**	5,42 %	21.07.2034	213.226	0,20
160.000	Morgan Stanley**	5,95 %	19.01.2038	161.877	0,15
100.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc*	4,90 %	28.02.2028	101.000	0,09
140.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc*	5,25 %	28.02.2053	137.794	0,13
210.000	NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc**	5,00 %	15.01.2033	210.463	0,19
109.000	Occidental Petroleum Corp*	6,13 %	01.01.2031	113.295	0,10
65.000	Occidental Petroleum Corp**	6,45 %	15.09.2036	68.860	0,06
155.000	Pacific Gas & Electric Co*	6,95 %	15.03.2034	170.456	0,16
105.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd*	5,34 %	19.05.2063	106.095	0,10
110.000	Phillips 66*	1,30 %	15.02.2026	102.255	0,09
230.000	Pilgrim's Pride Corp**	6,88 %	15.05.2034	248.592	0,23
200.000	PNC Financial Services Group Inc**	6,88 %	20.10.2034	222.112	0,20
235.000	RTX Corp*	6,40 %	15.03.2054	272.250	0,25
695.000	SBA Tower Trust†	2,59 %	15.10.2056	560.767	0,52

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,54 % (31. Dezember 2022: 32,90 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
150.000	Sempra*	5,50 %	01.08.2033	155.595	0,14
130.000	Simon Property Group LP*	6,25 %	15.01.2034	141.517	0,13
255.000	Societe Generale SA**	1,49 %	14.12.2026	234.900	0,22
495.000	Southern Co*	5,20 %	15.06.2033	505.317	0,46
150.000	Southern Co Gas Capital Corp*	1,75 %	15.01.2031	122.793	0,11
385.000	Sprint Capital Corp**	8,75 %	15.03.2032	475.644	0,44
175.000	T-Mobile USA Inc*	2,55 %	15.02.2031	150.814	0,14
205.000	T-Mobile USA Inc**	3,38 %	15.04.2029	190.699	0,18
65.000	Travelers Cos Inc*	5,45 %	25.05.2053	70.204	0,06
200.000	UBS AG**	5,65 %	11.09.2028	207.554	0,19
310.000	UBS Group AG**	6,54 %	12.08.2033	331.011	0,30
265.000	Ventas Realty LP*	3,50 %	15.04.2024	263.026	0,24
130.000	Verizon Communications Inc*	5,05 %	09.05.2033	132.686	0,12
180.000	Vodafone Group Plc**	4,38 %	19.02.2043	157.118	0,14
405.000	Warnermedia Holdings Inc**	5,14 %	15.03.2052	347.873	0,32
	US-Dollar insgesamt			**19.920.838**	**18,32**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**28.855.602**	**26,54**
	Staatsanleihen 39,07 % (31. Dezember 2022: 39,81 %)				
	Australischer Dollar				
513.000	New South Wales Treasury Corp*	4,25 %	20.02.2036	333.695	0,31
650.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond**	5,10 %	28.11.2030	457.721	0,42
519.000	Queensland Treasury Corp*	4,50 %	09.03.2033	356.622	0,33
383.000	Queensland Treasury Corp*	5,25 %	21.07.2036	274.356	0,25
	Australischer Dollar insgesamt			**1.422.394**	**1,31**
	Kanadischer Dollar				
785.000	Canadian Government Bond*	2,00 %	01.12.2051	479.518	0,44
1.261.000	Canadian Government Bond*	2,25 %	01.06.2029	917.898	0,84
935.000	Canadian Government Bond*	3,25 %	01.09.2028	711.576	0,66
418.000	City of Toronto Canada**	4,25 %	11.07.2033	327.057	0,30
	Kanadischer Dollar insgesamt			**2.436.049**	**2,24**
	Euro				
742.000	Autonomous Community of Madrid Spain*	3,36 %	31.10.2028	842.813	0,77
1.236.000	Autonomous Community of Madrid Spain*	3,60 %	30.04.2033	1.416.897	1,30
604.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	2,30 %	15.02.2033	684.631	0,63
248.000	European Union*	0,40 %	04.02.2037	202.790	0,19
139.000	European Union*	0,45 %	04.07.2041	100.691	0,09
260.000	European Union*	2,50 %	04.10.2052	255.246	0,23

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 39,07 % (31. Dezember 2022: 39,81 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
430.000	European Union*	3,38 %	04.10.2038	499.325	0,46
1.057.000	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.05.2028	1.096.472	1,01
1.500.000	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender*	3,00 %	26.04.2030	1.705.981	1,57
121.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,70 %	01.09.2051	82.297	0,08
218.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	3,45 %	01.03.2048	215.771	0,19
700.000	Junta de Castilla y Leon*	3,50 %	30.04.2033	788.473	0,72
742.000	Land Baden-Wuerttemberg*	3,00 %	27.06.2033	851.982	0,78
250.000	Land Berlin*	2,88 %	05.04.2029	281.888	0,26
785.000	Land Berlin*	3,00 %	04.05.2028	886.986	0,82
905.000	Land Berlin*	3,00 %	11.07.2031	1.030.596	0,95
500.000	Land Thueringen*	3,00 %	15.11.2028	566.203	0,52
296.000	Spain Government Bond*	2,70 %	31.10.2048	281.733	0,26
308.000	Spain Government Bond*	3,15 %	30.04.2033	346.270	0,32
517.000	Spain Government Bond*	5,15 %	31.10.2028	638.430	0,59
1.300.000	State of Brandenburg*	3,00 %	20.07.2033	1.486.697	1,37
2.050.000	State of Hesse*	2,88 %	04.07.2033	2.321.554	2,13
462.000	State of North Rhine-Westphalia Germany*	3,00 %	27.01.2028	521.346	0,48
450.000	State of Schleswig-Holstein Germany*	2,88 %	10.05.2028	505.778	0,47
980.000	State of Schleswig-Holstein Germany*	3,00 %	05.06.2030	1.116.192	1,03
	Euro insgesamt			**18.727.042**	**17,22**
	Indonesische Rupiah				
13.629.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.04.2032	873.102	0,80
23.773.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,63 %	15.05.2033	1.549.483	1,43
	Indonesische Rupiah insgesamt			**2.422.585**	**2,23**
	Japanischer Yen				
152.350.000	Japan Government Five Year Bond*	0,01 %	20.09.2026	1.079.425	0,99
120.800.000	Japan Government Forty Year Bond*	0,40 %	20.03.2056	585.059	0,54
23.800.000	Japan Government Forty Year Bond*	1,00 %	20.03.2062	133.869	0,12
14.800.000	Japan Government Ten Year Bond*	0,50 %	20.03.2033	104.202	0,10
163.050.000	Japan Government Thirty Year Bond*	0,70 %	20.12.2048	947.901	0,87
13.800.000	Japan Government Thirty Year Bond*	1,20 %	20.06.2053	87.506	0,08
76.850.000	Japan Government Twenty Year Bond*	0,40 %	20.03.2039	491.634	0,45
139.500.000	Japan Government Twenty Year Bond*	0,50 %	20.09.2041	865.770	0,80
37.700.000	Japan Government Twenty Year Bond*	1,10 %	20.03.2043	254.999	0,24
	Japanischer Yen insgesamt			**4.550.365**	**4,19**
	Mexikanischer Peso				
15.200.000	Mexican Bonos*	7,50 %	26.05.2033	819.455	0,75
	Mexikanischer Peso insgesamt			**819.455**	**0,75**

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 39,07 % (31. Dezember 2022: 39,81 %) (Fortsetzung)				
	Neuseeländischer Dollar				
1.088.000	New Zealand Government Bond*	4,25 %	15.05.2034	682.094	0,63
	Neuseeländischer Dollar insgesamt			**682.094**	**0,63**
	Polnischer Zloty				
1.122.000	Republic of Poland Government Bond*	6,00 %	25.10.2033	302.813	0,28
	Polnischer Zloty insgesamt			**302.813**	**0,28**
	Britisches Pfund				
915.000	United Kingdom Gilt*	0,63 %	22.10.2050	514.195	0,47
93.000	United Kingdom Gilt*	1,25 %	22.10.2041	76.775	0,07
538.000	United Kingdom Gilt*	1,75 %	07.09.2037	530.074	0,49
425.732	United Kingdom Gilt*	3,75 %	22.10.2053	505.065	0,46
596.000	United Kingdom Gilt*	4,75 %	07.12.2030	822.364	0,76
	Britisches Pfund insgesamt			**2.448.473**	**2,25**
	Südkoreanischer Won				
524.340.000	Korea Treasury Bond*	2,13 %	10.06.2027	393.195	0,36
950.550.000	Korea Treasury Bond*	2,38 %	10.12.2031	694.659	0,64
880.110.000	Korea Treasury Bond*	2,50 %	10.03.2052	612.467	0,56
937.540.000	Korea Treasury Bond*	3,25 %	10.03.2028	729.453	0,67
	Südkoreanischer Won insgesamt			**2.429.774**	**2,23**
	Schweizer Franken				
300.000	Swiss Confederation Government Bond*	1,50 %	26.10.2038	399.725	0,37
	Schweizer Franken insgesamt			**399.725**	**0,37**
	US-Dollar				
1.200.000	Croatia Government International Bond*	6,00 %	26.01.2024	1.201.409	1,10
300.000	Indonesia Government International Bond*	3,55 %	31.03.2032	278.493	0,26
340.000	International Bank for Reconstruction & Development**	4,75 %	14.11.2033	359.349	0,33
90.000	Japan Bank for International Corp*	4,63 %	19.07.2028	91.273	0,08
200.000	Mexico Government International Bond*	4,75 %	27.04.2032	192.969	0,18
300.000	Panama Government International Bond*	2,25 %	29.09.2032	219.479	0,20
300.000	Panama Government International Bond*	6,85 %	28.03.2054	281.449	0,26
200.000	Romanian Government International Bond*	3,00 %	14.02.2031	170.649	0,16
400.000	Saudi Government International Bond*	5,00 %	18.01.2053	377.694	0,35
1.320.000	United States Treasury Note/Bond*	4,13 %	15.08.2053	1.334.644	1,23

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 39,07 % (31. Dezember 2022: 39,81 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
185.000	United States Treasury Note/Bond*	4,38 %	30.11.2028	189.336	0,17
990.000	United States Treasury Note/Bond*	4,50 %	15.11.2033	1.039.655	0,96
100.000	United States Treasury Note/Bond*	4,88 %	31.10.2028	104.406	0,09
	US-Dollar insgesamt			**5.840.805**	**5,37**
	Staatsanleihen insgesamt			**42.481.574**	**39,07**
	Mortgage-Backed Securities 20,82 % (31. Dezember 2022: 14,14 %)				
	US-Dollar				
322.649	Fannie Mae Pool	2,00 %	01.02.2051	267.026	0,25
141.191	Fannie Mae Pool	2,00 %	01.04.2051	115.998	0,11
73.528	Fannie Mae Pool	2,00 %	01.05.2051	60.772	0,06
234.183	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.08.2050	202.151	0,19
121.065	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.09.2050	103.711	0,10
526.874	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.01.2051	454.886	0,42
661.249	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.05.2051	569.051	0,52
722.158	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.06.2051	615.172	0,57
409.475	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.08.2051	351.701	0,32
258.663	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.09.2051	220.502	0,20
315.893	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.02.2052	269.009	0,25
143.175	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.12.2047	130.397	0,12
146.032	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.11.2048	131.576	0,12
152.640	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.02.2049	139.612	0,13
134.605	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.03.2050	120.290	0,11
136.510	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.04.2050	122.359	0,11
149.198	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.04.2051	132.392	0,12
46.720	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.12.2041	44.267	0,04
24.230	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.04.2042	22.953	0,02
28.833	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.05.2042	27.277	0,02
40.754	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.01.2043	38.404	0,04
62.711	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.12.2044	58.648	0,05
49.814	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.03.2045	46.510	0,04
75.359	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.12.2045	70.733	0,06
70.052	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.05.2046	65.405	0,06
22.807	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.06.2047	21.294	0,02
134.759	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.02.2048	125.818	0,12
92.959	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.08.2051	85.758	0,08
55.691	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.07.2052	51.122	0,05
22.385	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.12.2040	21.839	0,02
76.723	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.12.2041	75.192	0,07
32.949	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.01.2045	31.777	0,03

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 20,82 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
59.344	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.02.2045	57.253	0,05
129.752	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.02.2046	125.342	0,12
32.647	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2046	31.496	0,03
30.569	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.03.2047	29.482	0,03
37.517	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.05.2047	36.183	0,03
46.927	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.06.2047	45.254	0,04
22.173	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.10.2047	21.279	0,02
25.046	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.04.2048	24.135	0,02
123.206	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.03.2049	118.596	0,11
12.691	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.03.2036	12.536	0,01
62.779	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.04.2041	62.722	0,06
12.138	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.09.2043	12.053	0,01
9.735	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.12.2043	9.666	0,01
22.074	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.05.2044	21.767	0,02
6.561	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.03.2047	6.491	0,01
68.984	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.07.2047	68.262	0,06
73.448	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.06.2052	71.248	0,07
159.214	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.07.2052	154.445	0,14
260.110	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.08.2052	252.319	0,23
9.442	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.07.2035	9.598	0,01
18.724	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.06.2038	19.034	0,02
27.259	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.07.2039	27.711	0,03
24.297	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.09.2040	24.700	0,02
27.845	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.02.2041	28.272	0,03
27.712	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.01.2044	28.138	0,03
8.172	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.03.2044	8.268	0,01
5.985	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.06.2048	6.013	0,01
40.491	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.09.2048	40.764	0,04
268.766	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.08.2052	266.346	0,24
67.891	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.09.2052	67.217	0,06
822.964	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.01.2053	815.449	0,75
368.816	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.02.2053	365.017	0,34
123.702	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.04.2053	122.428	0,11
441.694	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.12.2052	444.528	0,41
175.989	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.02.2053	176.829	0,16
37.427	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.05.2053	37.613	0,03
244.631	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.07.2053	245.765	0,23
77.899	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.09.2053	78.232	0,07
570.000	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.01.2054	572.494	0,53
98.189	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.06.2053	99.735	0,09

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 20,82 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
379.907	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.10.2053	386.449	0,36
835.000	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.01.2054	847.916	0,78
266.167	Fannie Mae Pool	6,50 %	01.10.2053	272.850	0,25
270.148	Fannie Mae Pool	6,50 %	01.11.2053	276.931	0,25
272.907	Fannie Mae Pool	6,50 %	01.12.2053	279.759	0,26
23.416	Fannie Mae Pool (AJ7686)	4,00 %	01.12.2041	22.806	0,02
21.250	Fannie Mae Pool (AL6432)	4,00 %	01.01.2045	20.495	0,02
16.109	Fannie Mae Pool (AS7558)	4,00 %	01.07.2046	15.541	0,01
17.499	Fannie Mae Pool (BH2877)	4,00 %	01.05.2047	16.877	0,02
244.531	Fannie Mae Pool (BV7959)	5,00 %	01.08.2052	242.329	0,22
281.257	Fannie Mae Pool (CB1552)	2,50 %	01.09.2051	239.396	0,22
281.956	Fannie Mae Pool (CB4133)	4,50 %	01.07.2052	273.511	0,25
330.881	Fannie Mae Pool (FS5235)	5,50 %	01.07.2053	332.409	0,31
411.693	Fannie Mae Pool (MA4325)	2,00 %	01.05.2051	337.893	0,31
620.105	Fannie Mae Pool (MA4701)	4,50 %	01.08.2052	601.532	0,55
22.908	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.10.2042	21.654	0,02
24.741	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.05.2043	23.306	0,02
15.388	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.06.2043	14.488	0,01
11.961	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.04.2045	11.183	0,01
55.351	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.08.2045	51.750	0,05
12.059	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.12.2045	11.274	0,01
11.987	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.04.2046	11.207	0,01
114.693	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.04.2047	107.229	0,10
48.293	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.07.2047	45.311	0,04
16.514	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.09.2047	15.408	0,01
23.106	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.10.2047	21.602	0,02
125.896	Freddie Mac Gold Pool	3,50 %	01.12.2047	117.702	0,11
38.903	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.02.2041	37.998	0,03
27.764	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.11.2041	27.055	0,02
15.258	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.11.2044	14.741	0,01
11.861	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.03.2046	11.455	0,01
86.671	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.04.2046	83.707	0,08
14.289	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.09.2046	13.800	0,01
169.555	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.12.2046	163.772	0,15
71.269	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.01.2047	68.831	0,06
87.802	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.04.2047	84.753	0,08
13.924	Freddie Mac Gold Pool	4,00 %	01.05.2047	13.448	0,01
36.902	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.08.2039	36.922	0,03
11.487	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.12.2039	11.493	0,01

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 20,82 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
3.840	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.03.2041	3.841	0,00
34.956	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.11.2043	34.759	0,03
5.879	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.10.2046	5.836	0,01
40.399	Freddie Mac Gold Pool	4,50 %	01.09.2048	39.749	0,04
7.605	Freddie Mac Gold Pool	5,00 %	01.10.2035	7.742	0,01
17.873	Freddie Mac Gold Pool	5,00 %	01.09.2038	18.195	0,02
16.395	Freddie Mac Gold Pool	5,00 %	01.03.2047	16.520	0,01
9.888	Freddie Mac Gold Pool (Q18306)	3,50 %	01.05.2043	9.315	0,01
97.374	Freddie Mac Pool	2,00 %	01.07.2051	79.837	0,07
487.429	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.12.2050	415.228	0,38
112.658	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.08.2051	96.055	0,09
415.864	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.01.2052	354.122	0,33
68.105	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.02.2050	61.039	0,06
41.075	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.03.2048	38.347	0,03
137.033	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.07.2052	132.929	0,12
340.847	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.08.2052	330.638	0,30
179.503	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.08.2052	177.886	0,16
316.439	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.10.2052	313.179	0,29
238.152	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.09.2052	239.914	0,22
236.991	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.11.2052	238.845	0,22
336.300	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.01.2053	338.014	0,31
186.994	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.03.2053	187.975	0,17
118.431	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.06.2053	118.956	0,11
54.060	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.07.2053	54.384	0,05
389.553	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.02.2053	395.973	0,36
358.311	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.03.2053	364.032	0,33
346.406	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.04.2053	351.864	0,32
639.635	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.05.2053	649.890	0,60
370.844	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.06.2053	376.686	0,35
82.001	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.09.2053	83.280	0,08
272.883	Freddie Mac Pool	6,50 %	01.09.2053	280.584	0,26
453.136	Freddie Mac Pool (SD3010)	5,50 %	01.06.2053	456.348	0,42
380.135	Freddie Mac Pool (SD3908)	6,00 %	01.09.2053	387.179	0,36
128.566	Freddie Mac Pool (SD8221)	3,50 %	01.06.2052	117.972	0,11
109.352	Ginnie Mae II Pool	2,50 %	20.03.2051	95.681	0,09
359.282	Ginnie Mae II Pool	2,50 %	20.04.2051	314.663	0,29
187.808	Ginnie Mae II Pool	4,50 %	20.09.2052	183.397	0,17
135.689	Ginnie Mae II Pool	5,00 %	20.03.2053	134.850	0,12
103.882	Ginnie Mae II Pool	5,00 %	20.07.2053	103.143	0,09

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 20,82 % (31. Dezember 2022: 14,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
168.582	Ginnie Mae II Pool	5,50 %	20.03.2053	169.888	0,16
237.743	Ginnie Mae II Pool	6,00 %	20.08.2053	241.849	0,22
	Mortgage-Backed Securities insgesamt **			**22.645.649**	**20,82**
	Kommunalanleihen 1,18 % (31. Dezember 2022: 1,27 %)				
	US-Dollar				
520.000	New York City Municipal Water Finance Authority	6,01 %	15.06.2042	586.632	0,54
325.000	State of California	4,60 %	01.04.2038	313.926	0,29
500.000	State of Hawaii	2,85 %	01.10.2040	378.218	0,35
	Kommunalanleihen insgesamt †			**1.278.776**	**1,18**
	Anlagen insgesamt			**107.272.645**	**98,65**

Devisenterminkontrakte 3,07 % (31. Dezember 2022: 1,96 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
1.164.861 AUD	744.219 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	51.037	0,05
3.544.085 AUD	2.254.524 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	165.042	0,15
1.136.822 AUD	740.528 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	3	35.586	0,03
3.244.635 AUD	2.089.524 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	5	125.605	0,12
268.472 AUD	174.587 US$	18.01.2024	UBS AG	1	8.700	0,01
2.967.931 AUD	1.888.455 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	137.767	0,13
2.660.392 BRL	520.817 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	26.264	0,02
1.119.811 CAD	812.601 US$	18.01.2024	BNP Paribas	3	36.834	0,03
2.399.644 CAD	1.750.297 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	69.960	0,07
242.887 CAD	177.382 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	6.861	0,01
271.034 CAD	201.796 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	3.798	0,00
944.652 CAD	685.558 US$	18.01.2024	UBS AG	3	31.010	0,03
233.282 CAD	172.082 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	4.875	0,01
774.916 CHF	867.115 US$	18.01.2024	BNP Paribas	2	55.098	0,05
454.526 CHF	506.758 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	34.165	0,03
1.094.115 CHF	1.230.021 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	72.064	0,07
318.657 CHF	358.606 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	20.622	0,02
792.057 CHF	885.348 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	57.264	0,05
944.534 CHF	1.081.029 US$	18.01.2024	UBS AG	2	43.043	0,04
74.993 CHF	84.146 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	5.101	0,01
160.433.264 CLP	172.853 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	10.718	0,01
70.844.418 CLP	76.085 US$	18.01.2024	Société Générale	1	4.976	0,01
345.634.694 CLP	370.059 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	25.424	0,02
4.075.031 CNY	560.250 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	12.661	0,01
920.927 CNY	127.505 US$	18.01.2024	BNP Paribas	2	2.589	0,00

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 3,07 % (31. Dezember 2022: 1,96 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
503.379 CNY	70.837 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	273	0,00
76.514.161 CNY	10.604.979 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	3	203.698	0,19
562.437.353 COP	129.742 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	14.974	0,01
8.733.188 CZK	375.858 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	14.698	0,01
8.244.034 CZK	359.466 US$	18.01.2024	UBS AG	2	9.214	0,01
110.000 DKK	15.588 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	726	0,00
2.926.898 €	3.122.208 US$	18.01.2024	BNP Paribas	7	113.002	0,10
900.000 €	970.893 US$	18.01.2024	Canadian Imperial Bank of Commerce	1	23.911	0,02
2.168.533 €	2.330.957 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	66.004	0,06
1.774.558 €	1.888.129 US$	18.01.2024	Société Générale	3	73.356	0,07
1.022.980 €	1.092.816 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	4	37.922	0,04
735.457 €	793.518 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	19.410	0,02
1.237.017 €	1.341.893 US$	18.01.2024	UBS AG	4	25.428	0,02
1.264.778 €	1.384.817 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	13.190	0,01
849.442 £	1.039.214 US$	18.01.2024	BNP Paribas	3	43.749	0,04
280.616 £	352.342 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	5.418	0,01
721.046 £	875.020 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	44.251	0,04
284.949 £	350.000 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	13.285	0,01
300.000 £	366.501 US$	18.01.2024	Société Générale	1	15.973	0,02
875.934 £	1.092.110 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	5	24.628	0,02
687.200 £	853.414 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	4	22.706	0,02
432.184 £	537.004 US$	18.01.2024	UBS AG	1	13.993	0,01
110.000 £	139.216 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	1.024	0,00
223.568 HKD	28.631 US$	18.01.2024	Société Générale	1	10	0,00
95.440.648 HUF	264.059 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	11.162	0,01
73.482.032 HUF	197.861 US$	18.01.2024	Société Générale	2	14.038	0,01
64.151.109 HUF	181.926 US$	18.01.2024	UBS AG	1	3.066	0,00
2.585.137.634 IDR	165.767 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	1.918	0,00
2.004.836.042 IDR	126.701 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	2	3.343	0,00
937.662.828 IDR	60.710 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	111	0,00
3.133.715 IDR	199 US$	18.01.2024	UBS AG	1	4	0,00
568.748 ILS	144.681 US$	18.01.2024	Société Générale	1	13.307	0,01
79.532.567 ¥	542.554 US$	18.01.2024	BNP Paribas	2	22.948	0,02
27.000.000 ¥	188.257 US$	18.01.2024	Canadian Imperial Bank of Commerce	1	3.721	0,00
229.816.701 ¥	1.548.213 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	85.856	0,08
1.005.159.939 ¥	6.852.851 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	2	294.149	0,27
21.795.910 ¥	147.900 US$	18.01.2024	Société Générale	1	7.075	0,01
115.121.993 ¥	785.103 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	33.450	0,03
89.397.501 ¥	621.589 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	4	14.055	0,01
179.603.849 ¥	1.208.481 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	68.558	0,06
439.000.000 KRW	338.353 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	396	0,00

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 3,07 % (31. Dezember 2022: 1,96 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
79.490 KRW	60 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	2	0,00
3.123.700.000 KRW	2.398.437 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	11.932	0,01
226.000.000 KRW	168.381 US$	18.01.2024	UBS AG	1	6.009	0,01
700.000 MXN	39.892 US$	18.01.2024	Canadian Imperial Bank of Commerce	1	1.337	0,00
18.067.615 MXN	974.181 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	89.958	0,08
6.183.447 MXN	349.249 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	14.941	0,01
3.122.924 MXN	177.644 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	6.288	0,01
2.000.630 MYR	426.283 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	10.350	0,01
6.639.894 NOK	613.498 US$	18.01.2024	BNP Paribas	4	40.576	0,04
1.927.265 NOK	178.721 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	11.127	0,01
2.930.156 NOK	265.489 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	23.151	0,02
1.955.008 NOK	174.589 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	17.993	0,02
17.021.100 NOK	1.557.335 US$	18.01.2024	UBS AG	4	119.356	0,11
292.014 NZD	175.877 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	9.023	0,01
1.478.707 NZD	861.863 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	74.437	0,07
57.000 NZD	27.432 £	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	1.118	0,00
3.151.225 NZD	1.849.350 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	6	145.971	0,13
1.027.717 NZD	618.179 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	32.561	0,03
27.000 NZD	14.986 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	531	0,00
250.572 PEN	65.030 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	2.612	0,00
1.468.541 PLN	356.931 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	16.453	0,02
175.000 PLN	33.850 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	1.338	0,00
730.345 PLN	175.567 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	10.127	0,01
2.182.938 PLN	523.293 US$	18.01.2024	UBS AG	3	31.730	0,03
540.000 PLN	136.824 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	473	0,00
439.804 RON	95.430 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	2.209	0,00
10.394.837 SEK	949.816 US$	18.01.2024	BNP Paribas	4	82.296	0,08
5.702.995 SEK	515.420 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	50.835	0,05
7.579.308 SEK	698.940 US$	18.01.2024	Société Générale	2	53.616	0,05
120.000 SEK	8.921 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	541	0,00
4.654.420 SEK	455.043 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	7.098	0,01
351.517 SGD	258.600 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	8.077	0,01
13.530.200 THB	371.763 US$	18.01.2024	Société Générale	1	25.183	0,02
57.765 US$	74.810.335 KRW	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	38	0,00
32.905 ZAR	1.705 US$	18.01.2024	Société Générale	1	92	0,00
Abgesicherte Klassen AUD						
1.461 AUD	957 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	5	41	0,00
28.805 AUD	18.586 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	8	1.080	0,00
Abgesicherte Klassen EUR						
6.343 €	6.759 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	252	0,00
83 €	636 CNY	18.01.2024	BNP Paribas	1	2	0,00

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 3,07 % (31. Dezember 2022: 1,96 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR (Fortsetzung)						
2.539 €	19.487 CNY	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	54	0,00
58 €	83 SGD	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	1	0,00
325 €	462.536 KRW	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	2	0,00
6.348 €	6.759 US$	18.01.2024	Société Générale	1	258	0,00
125 €	2.088.240 IDR	18.01.2024	Société Générale	1	2	0,00
748 €	1.079 CAD	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	9	0,00
5.621 ¥	36 €	18.01.2024	BNP Paribas	1	0	0,00
Abgesicherte Klassen USD						
87 €	93 US$	18.01.2024	UBS AG	1	3	0,00
Abgesicherte Klassen ZAR						
316.445 ZAR	16.351 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	2	930	0,00
20.010 ZAR	1.053 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	5	39	0,00
12.667 ZAR	687 US$	18.01.2024	UBS AG	4	4	0,00
7.336 ZAR	392 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	9	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**3.337.129**	**3,07**

Futures-Kontrakte 0,41 % (31. Dezember 2022: 0,20 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
3	10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2024	2.674	0,00
2	Australian Government Bond 10-Year Future March 2024	5.067	0,00
2	Canadian 10-Year Bond Future March 2024	9.100	0,01
14	Canadian 5-Year Bond Future March 2024	32.170	0,03
28	Euro-BOBL Future March 2024	63.098	0,06
3	Euro-BTP Future March 2024	14.051	0,01
5	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024	59.872	0,06
5	Euro-OAT Future March 2024	25.186	0,02
45	Euro-Schatz Future March 2024	32.311	0,03
6	United Kingdom Long Gilt Future March 2024	37.760	0,04
6	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	22.279	0,02
18	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024	32.849	0,03
24	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	39.703	0,04
5	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	64.570	0,06
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**440.690**	**0,41**

Zinsswap-Kontrakte 0,11 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Nominalwert		Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
CNY	31.096.000	28.11.2025	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,60 %	7D CNRR	49.787	0,05
CNY	9.273.000	30.11.2027	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,82 %	7D CNRR	31.192	0,03

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte 0,11 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)

Nominalwert		Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)[#]	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
EUR	1.780.000	02.11.2035	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	3,63 %	1D €STR	27.654	0,02
CNY	9.773.000	31.05.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,50 %	7D CNRR	16.075	0,01
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten [∞]							**124.708**	**0,11**

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**111.175.172**	**102,24**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (2,94 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
48.216 €	42.000 £	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(252)	(0,00)
300.000 €	288.440 CHF	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(11.666)	(0,01)
3.000 £	3.464 €	18.01.2024	Société Générale	1	(4)	(0,00)
856.832 US$	6.128.433 CNY	18.01.2024	BNP Paribas	3	(8.893)	(0,01)
1.064.209 US$	11.733.648 NOK	18.01.2024	BNP Paribas	4	(91.633)	(0,08)
880.773 US$	1.482.688 NZD	18.01.2024	BNP Paribas	3	(58.048)	(0,05)
522.355 US$	2.200.583 PLN	18.01.2024	BNP Paribas	2	(37.153)	(0,03)
1.742.638 US$	2.708.815 AUD	18.01.2024	BNP Paribas	5	(106.684)	(0,10)
92.759 US$	34.017.402 HUF	18.01.2024	BNP Paribas	1	(5.337)	(0,01)
1.358.233 US$	198.572.552 ¥	18.01.2024	BNP Paribas	3	(53.679)	(0,05)
484.745 US$	5.250.684 SEK	18.01.2024	BNP Paribas	3	(36.599)	(0,03)
1.644.192 US$	1.463.231 CHF	18.01.2024	BNP Paribas	5	(97.170)	(0,09)
181.344 US$	169.258.971 CLP	18.01.2024	BNP Paribas	1	(12.326)	(0,01)
2.446.367 US$	3.340.443 CAD	18.01.2024	BNP Paribas	7	(87.535)	(0,08)
512.298 US$	9.275.943 MXN	18.01.2024	BNP Paribas	2	(34.031)	(0,03)
502.094 US$	408.265 £	18.01.2024	BNP Paribas	2	(18.408)	(0,02)
1.227.217 US$	1.146.890 €	18.01.2024	BNP Paribas	3	(40.483)	(0,04)
172.964 US$	136.058 £	18.01.2024	Citibank NA	1	(498)	(0,00)
513.454 US$	481.525 €	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(18.794)	(0,02)
359.304 US$	6.570.551 MXN	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(27.686)	(0,03)
519.553 US$	2.181.227 PLN	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(35.033)	(0,03)
3.731.074 US$	4.978.521.917 KRW	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(110.546)	(0,10)
347.061 US$	1.728.547 BRL	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(8.395)	(0,01)
2.155.459 US$	23.373.727 SEK	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	(165.336)	(0,15)

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (2,94 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
1.612.799 US$	2.504.416 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	(96.979)	(0,09)
1.097.875 US$	891.752 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(39.031)	(0,04)
55.768 US$	1.956.580 THB	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(1.633)	(0,00)
1.052.318 US$	1.445.601 CAD	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	(44.247)	(0,04)
2.127.439 US$	3.549.205 NZD	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(119.877)	(0,11)
715.416 US$	105.538.674 ¥	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(34.996)	(0,03)
585.147 US$	527.024 CHF	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(42.054)	(0,04)
3.076.425 US$	2.851.105 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	(75.009)	(0,07)
36.479 US$	32.000 CHF	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(1.604)	(0,00)
58.753 US$	93.667 NZD	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(555)	(0,00)
440.341 US$	63.761.214 ¥	18.01.2024	Royal Bank of Canada	2	(13.021)	(0,01)
122.483 US$	1.908.512.687 IDR	18.01.2024	Royal Bank of Canada	2	(1.313)	(0,00)
94.616 US$	86.702 €	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(1.219)	(0,00)
132.591 US$	175.992.362 KRW	18.01.2024	Royal Bank of Canada	2	(3.212)	(0,00)
1.893.369 US$	1.781.092 €	18.01.2024	Société Générale	1	(75.339)	(0,07)
4.094.628 US$	3.340.866 £	18.01.2024	Société Générale	2	(164.682)	(0,15)
719.926 US$	5.068.130 DKK	18.01.2024	Société Générale	1	(31.693)	(0,03)
971.686 US$	10.307.569 SEK	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(51.760)	(0,05)
560.911 US$	4.075.949 CNY	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(12.129)	(0,01)
347.514 US$	323.187.749 CLP	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(22.284)	(0,02)
881.788 US$	1.210.667 CAD	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(36.567)	(0,03)
881.953 US$	723.365 £	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(40.274)	(0,04)
611.959 US$	87.651.249 ¥	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(11.269)	(0,01)
338.083 US$	6.251.659 MXN	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(30.124)	(0,03)
411.187 US$	2.940.159 CNY	18.01.2024	Standard Chartered Bank	4	(4.150)	(0,00)
2.436.450 US$	2.296.258 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	5	(101.689)	(0,09)
69.107 US$	472.793 DKK	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(1.009)	(0,00)
1.113.162 US$	12.308.620 SEK	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	4	(108.971)	(0,10)
539.744 US$	5.899.053 NOK	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(41.351)	(0,04)
952.011 US$	1.454.561 AUD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(41.026)	(0,04)
627.439 US$	857.807 CAD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(23.252)	(0,02)
814.313 US$	117.171.615 ¥	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(18.813)	(0,02)
376.922 US$	303.851 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(10.461)	(0,01)
89.604 US$	31.973.212 HUF	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(2.597)	(0,00)
244.969 US$	4.376.701 MXN	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(12.807)	(0,01)
168.043 US$	271.025 NZD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(3.567)	(0,00)
2.657.887 US$	2.479.194 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	7	(82.460)	(0,08)
1.072.404 US$	960.858 CHF	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(71.095)	(0,07)
173.859 US$	63.430.886 HUF	18.01.2024	UBS AG	1	(9.056)	(0,01)
362.008 US$	599.376 NZD	18.01.2024	UBS AG	1	(17.511)	(0,02)
692.462 US$	101.898.884 ¥	18.01.2024	UBS AG	1	(32.071)	(0,03)

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (2,94 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
1.879.421 US$	1.757.809 €	18.01.2024	UBS AG	4	(63.551)	(0,06)
150.953 US$	119.098 £	18.01.2024	UBS AG	1	(887)	(0,00)
362.048 US$	8.412.570 CZK	18.01.2024	UBS AG	2	(14.169)	(0,01)
212.970 US$	928.698 PLN	18.01.2024	UBS AG	1	(23.155)	(0,02)
3.287.793 US$	2.902.957 CHF	18.01.2024	UBS AG	4	(166.961)	(0,15)
2.150.805 US$	33.842.792.935 IDR	18.01.2024	UBS AG	1	(44.413)	(0,04)
974.241 US$	10.672.857 NOK	18.01.2024	UBS AG	3	(77.105)	(0,07)
175.194 US$	1.835.584 SEK	18.01.2024	UBS AG	1	(7.062)	(0,01)
1.589.227 US$	2.483.050 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(105.964)	(0,10)
901.472 US$	835.327 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(21.846)	(0,02)
418.792 US$	343.060 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(18.579)	(0,02)
881.592 US$	1.474.210 NZD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(51.861)	(0,05)
Abgesicherte Klassen AUD						
309 AUD	212 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(1)	(0,00)
165 US$	260 AUD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(12)	(0,00)
309 US$	475 AUD	18.01.2024	UBS AG	3	(15)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
385 €	638 AUD	18.01.2024	BNP Paribas	1	(10)	(0,00)
52 €	602 SEK	18.01.2024	BNP Paribas	1	(2)	(0,00)
16 €	14 £	18.01.2024	BNP Paribas	1	(0)	(0,00)
42 €	76 NZD	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(1)	(0,00)
1.084 €	940 £	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(0)	(0,00)
89 €	1.713 MXN	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(3)	(0,00)
150 €	143 CHF	18.01.2024	Société Générale	1	(4)	(0,00)
3.076 €	480.086 ¥	18.01.2024	Société Générale	2	(13)	(0,00)
52 €	602 SEK	18.01.2024	Société Générale	1	(2)	(0,00)
157 US$	147 €	18.01.2024	BNP Paribas	1	(5)	(0,00)
Abgesicherte Klassen USD						
86 US$	623 CNY	18.01.2024	BNP Paribas	1	(2)	(0,00)
136 US$	128 €	18.01.2024	BNP Paribas	1	(6)	(0,00)
65 US$	88 SGD	18.01.2024	BNP Paribas	1	(2)	(0,00)
29 US$	24 £	18.01.2024	BNP Paribas	1	(1)	(0,00)
40 US$	5.847 ¥	18.01.2024	BNP Paribas	1	(2)	(0,00)
6.473 US$	6.116 €	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(287)	(0,00)
3.273 US$	477.879 ¥	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(125)	(0,00)
1.154 US$	948 £	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(54)	(0,00)
97 US$	1.800 MXN	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(9)	(0,00)
107 US$	1.169 SEK	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(9)	(0,00)
158 US$	143 CHF	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(12)	(0,00)
47 US$	79 NZD	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(3)	(0,00)
63 US$	442 DKK	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(3)	(0,00)

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (2,94 %) (31. Dezember 2022: (1,42 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen USD (Fortsetzung)						
793 US$	1.087 CAD	18.01.2024	UBS AG	1	(32)	(0,00)
406 US$	637 AUD	18.01.2024	UBS AG	1	(29)	(0,00)
135 US$	2.125.094 IDR	18.01.2024	UBS AG	1	(3)	(0,00)
2.766 US$	19.893 CNY	18.01.2024	UBS AG	1	(44)	(0,00)
349 US$	464.591 KRW	18.01.2024	UBS AG	1	(10)	(0,00)
89 US$	3.262 THB	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(7)	(0,00)
Abgesicherte Klassen ZAR						
380 US$	7.158 ZAR	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(11)	(0,00)
311 US$	5.884 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(10)	(0,00)
4.698 ZAR	257 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(0)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(3.195.228)**	**(2,94)**

Futures-Kontrakte (0,57 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
(33)	Euro-Bund Future March 2024	(111.757)	(0,10)
(19)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	(70.858)	(0,06)
(68)	US Treasury 10-Year Ultra Future March 2024	(390.469)	(0,36)
(8)	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	(19.724)	(0,02)
(3)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024	(30.164)	(0,03)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(622.972)**	**(0,57)**

Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
USD 3.720.000	20.12.2028	ICE Clear U.S.[1]	Buying default protection on CDX.NA.IG.41.V1	(72.291)	(0,07)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt ±				**(72.291)**	**(0,07)**

[1]Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(3.890.491)**	**(3,58)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**107.284.681**	**98,66**
Sonstiges Nettovermögen	**1.458.119**	**1,34**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**108.742.800**	**100,00**

Global Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	59.984.843	52,53
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	45.448.259	39,80
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	1.839.543	1,61
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(182.282)	(0,16)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	194.318	0,17
Anlagen insgesamt		**107.284.681**	**93,95**

Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Schatzwechsel 12,01 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
	US-Dollar				
18.810.000	United States Treasury Bill	0,00 %	18.01.2024	18.765.889	12,01
	Schatzwechsel insgesamt **			**18.765.889**	**12,01**
	Unternehmensanleihen 79,04 % (31. Dezember 2022: 93,73 %)				
	US-Dollar				
400.000	ABJA Investment Co Pte Ltd**	5,95 %	31.07.2024	399.120	0,26
249.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**	3,38 %	24.07.2024	244.198	0,16
2.944.000	Africa Finance Corp*	3,88 %	13.04.2024	2.923.813	1,87
1.444.000	African Export-Import Bank*	4,13 %	20.06.2024	1.431.423	0,92
3.000.000	Air Lease Corp*	0,70 %	15.02.2024	2.981.605	1,91
1.000.000	Air Lease Corp*	4,25 %	01.02.2024	998.460	0,64
1.100.000	Anglo American Capital Plc*	3,63 %	11.09.2024	1.082.747	0,69
1.500.000	Ares Capital Corp**	4,20 %	10.06.2024	1.485.981	0,95
4.100.000	Athene Global Funding**	2,75 %	25.06.2024	4.034.439	2,58
3.120.000	Avolon Holdings Funding Ltd**	5,25 %	15.05.2024	3.103.756	1,99
3.389.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT*	3,75 %	11.04.2024	3.369.128	2,16
3.250.000	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT**	3,95 %	28.03.2024	3.238.616	2,07
4.000.000	Barclays Plc*	4,38 %	11.09.2024	3.952.105	2,53
435.000	Bharti Airtel International Netherlands BV*	5,35 %	20.05.2024	434.695	0,28
2.500.000	Black Sea Trade & Development Bank*	3,50 %	25.06.2024	2.423.608	1,55
3.000.000	BOC Aviation Ltd**	4,00 %	25.01.2024	2.996.820	1,92
3.005.000	Buckeye Partners LP**	4,35 %	15.10.2024	2.947.792	1,89
750.000	CSC Holdings LLC**	5,25 %	01.06.2024	734.731	0,47
1.333.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,88 %	23.05.2024	1.318.964	0,84
2.200.000	Energy Transfer LP*	3,90 %	15.05.2024	2.183.875	1,40
3.685.000	EQM Midstream Partners LP*	4,00 %	01.08.2024	3.652.543	2,34
1.040.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,81 %	09.01.2024	1.039.541	0,67
3.385.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,58 %	18.03.2024	3.380.855	2,16
4.550.000	General Motors Financial Co Inc*	3,95 %	13.04.2024	4.523.747	2,90
944.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd*	5,13 %	15.05.2024	938.827	0,60
4.750.000	HSBC Holdings Plc*	4,25 %	14.03.2024	4.732.594	3,03
1.600.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,25 %	13.11.2024	1.552.000	0,99
1.100.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,75 %	29.05.2024	1.085.161	0,69
2.500.000	Hyundai Capital America**	3,40 %	20.06.2024	2.470.678	1,58
1.930.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,88 %	01.11.2024	1.914.309	1,23
1.500.000	Marriott International Inc**	3,60 %	15.04.2024	1.492.714	0,96
3.800.000	Mashreqbank PSC*	4,25 %	26.02.2024	3.796.846	2,43
1.450.000	MGM China Holdings Ltd**	5,38 %	15.05.2024	1.447.963	0,93
889.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd*	3,38 %	29.12.2049	874.554	0,56
3.000.000	Nationwide Building Society*	0,55 %	22.01.2024	2.992.276	1,92

Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 79,04 % (31. Dezember 2022: 93,73 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
4.600.000	NatWest Group Plc*	5,13 %	28.05.2024	4.578.556	2,93
1.803.000	NOVA Chemicals Corp**	4,88 %	01.06.2024	1.788.955	1,14
4.000.000	NRG Energy Inc**	3,75 %	15.06.2024	3.954.818	2,53
518.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,25 %	15.04.2024	515.115	0,33
1.500.000	QIB Sukuk Ltd*	3,98 %	26.03.2024	1.492.387	0,96
1.000.000	QIIB Senior Sukuk Ltd*	4,26 %	05.03.2024	996.786	0,64
2.500.000	Rakfunding Cayman Ltd*	4,13 %	09.04.2024	2.487.397	1,59
1.250.000	REC Ltd*	3,38 %	25.07.2024	1.234.915	0,79
450.000	REC Ltd*	3,50 %	12.12.2024	441.526	0,28
1.889.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*	4,22 %	27.01.2024	1.888.437	1,21
1.500.000	Shriram Finance Ltd*	4,40 %	13.03.2024	1.490.880	0,95
2.500.000	SNB Funding Ltd*	2,75 %	02.10.2024	2.442.095	1,56
2.600.000	Societe Generale SA**	2,63 %	16.10.2024	2.539.787	1,63
4.015.000	Sprint LLC**	7,13 %	15.06.2024	4.035.123	2,58
3.850.000	Synchrony Financial*	4,25 %	15.08.2024	3.809.341	2,44
3.180.000	TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc*	5,88 %	15.06.2024	3.183.641	2,04
2.600.000	Ventas Realty LP*	3,50 %	15.04.2024	2.580.629	1,65
4.000.000	Warnermedia Holdings Inc†	3,53 %	15.03.2024	3.955.359	2,53
1.000.000	Weibo Corp*	3,50 %	05.07.2024	989.385	0,63
889.000	Wynn Macau Ltd*	4,88 %	01.10.2024	878.369	0,56
	Unternehmensanleihen insgesamt			**123.463.985**	**79,04**
	Staatsanleihen 1,11 % (31. Dezember 2022: 2,45 %)				
	US-Dollar				
1.300.000	Egypt Government International Bond	6,20 %	01.03.2024	1.284.084	0,82
444.000	Republic of South Africa Government International Bond	4,67 %	17.01.2024	443.909	0,29
	Staatsanleihen insgesamt *			**1.727.993**	**1,11**
	Anlagen insgesamt			**143.957.867**	**92,16**

Devisenterminkontrakte 0,18 % (31. Dezember 2022: 0,33 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
2.321.841 €	2.473.592 US$	18.01.2024	UBS AG	3	92.826	0,06
Abgesicherte Klassen GBP						
1.879.639 £	2.307.839 US$	18.01.2024	UBS AG	2	88.534	0,06
23.430 £	28.540 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	1.331	0,00
Abgesicherte Klassen HKD						
6.868.511 HKD	879.585 US$	18.01.2024	UBS AG	3	333	0,00

Global Diversified Income FMP - 2024 - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,18 % (31. Dezember 2022: 0,33 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen SGD						
4.396.662 SGD	3.236.808 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	98.708	0,06
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**281.732**	**0,18**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**144.239.599**	**92,34**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**144.239.599**	**92,34**
Sonstiges Nettovermögen	**11.960.054**	**7,66**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**156.199.653**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	81.891.704	52,37
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	58.110.804	37,16
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	3.955.359	2,53
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	281.732	0,18
Anlagen insgesamt		**144.239.599**	**92,24**

Global Equity Megatrends - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 97,93 % (31. Dezember 2022: 100,15 %)		
	Kanadischer Dollar		
342.482	Element Fleet Management Corp	5.599.812	3,88
	Kanadischer Dollar insgesamt	**5.599.812**	**3,88**
	Britisches Pfund		
1.867.832	Pets at Home Group Plc	7.576.699	5,24
	Britisches Pfund insgesamt	**7.576.699**	**5,24**
	US-Dollar		
103.779	Alibaba Group Holding Ltd ADR	8.043.910	5,57
46.267	Alphabet Inc Class A	6.463.037	4,47
79.388	Amdocs Ltd	6.977.411	4,83
98.119	ATI Inc	4.461.471	3,09
208.596	Corning Inc	6.351.748	4,40
333.254	Criteo SA ADR	8.437.991	5,84
176.145	Delta Air Lines Inc	7.086.313	4,90
640.813	Despegar.com Corp	6.062.091	4,19
242.040	Element Solutions Inc	5.600.806	3,88
60.322	Expedia Group Inc	9.156.276	6,34
314.583	Gen Digital Inc	7.178.784	4,97
163.557	ModivCare Inc	7.194.873	4,98
14.601	Nice Ltd ADR	2.913.046	2,02
237.296	Perrigo Co Plc	7.636.185	5,28
157.093	Scholastic Corp	5.922.406	4,10
137.700	Stericycle Inc	6.824.412	4,72
23.440	TE Connectivity Ltd	3.293.320	2,28
9.665	Tetra Tech Inc	1.613.379	1,12
104.724	Uber Technologies Inc	6.447.857	4,46
149.433	Vistra Corp	5.756.159	3,98
554.945	Zeta Global Holdings Corp Class A	4.894.615	3,39
	US-Dollar insgesamt	**128.316.090**	**88,81**
	Aktien insgesamt *	**141.492.601**	**97,93**
	Anlagen insgesamt	**141.492.601**	**97,93**

Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen SGD						
40.207 SGD	30.060 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	444	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**444**	**0,00**

Global Equity Megatrends - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**141.493.045**	**97,93**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**141.493.045**	**97,93**
Sonstiges Nettovermögen	**2.989.811**	**2,07**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**144.482.856**	**100,00**

Portfolioanalyse		**US$**	**% des Gesamtver-mögens**
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	141.492.601	95,72
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	444	0,00
Anlagen insgesamt		**141.493.045**	**95,72**

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 1,54 % (31. Dezember 2022: 1,33 %)		
	US-Dollar		
5.000	McAfee LLC	6.022.083	1,54
	Aktien insgesamt *	**6.022.083**	**1,54**

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 5,92 % (31. Dezember 2022: 6,10 %)				
	US-Dollar				
2.000.000	AGL CLO 19 Ltd Series 2022-19X Class E	13,33 %	21.07.2035	2.001.634	0,51
2.500.000	Aimco CDO Series 2021-16X Class D	8,48 %	17.01.2035	2.469.014	0,63
1.950.000	CIFC Funding 2018-I Ltd Class D	8,31 %	18.04.2031	1.922.372	0,49
500.000	CIFC Funding 2018-II Ltd Class C	8,53 %	20.04.2031	492.818	0,13
375.000	COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust Class D	3,60 %	10.06.2046	341.396	0,09
745.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 Class 1B1	8,44 %	25.10.2041	752.356	0,19
520.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2B1	9,84 %	25.01.2042	536.591	0,14
390.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2M2	8,34 %	25.01.2042	395.876	0,10
187.000	CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust Class C	4,90 %	15.11.2051	149.319	0,04
1.000.000	Dryden 93 CLO Ltd Series 2021-93X Class D	8,53 %	15.01.2034	979.817	0,25
191.000	Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust Class A	3,55 %	10.09.2035	172.020	0,04
525.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1B1	9,20 %	25.10.2030	564.224	0,15
286.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6 Class B1	8,74 %	25.10.2041	291.145	0,08
847.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7 Class B1	8,99 %	25.11.2041	864.273	0,22
265.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA3 Class M2	7,44 %	25.09.2041	261.907	0,07
180.000	GS Mortgage Securities Trust 2015-GS1 Class AS	4,04 %	10.11.2048	162.023	0,04
359.000	GS Mortgage Securities Trust 2016-GS4 Class B	3,85 %	10.11.2049	320.321	0,08
295.000	Hilton USA Trust 2016-HHV Class C	4,19 %	05.11.2038	280.128	0,07
100.000	Hilton USA Trust 2016-HHV Class D	4,19 %	05.11.2038	93.761	0,02
590.000	Hilton USA Trust 2016-HHV Class E	4,19 %	05.11.2038	546.229	0,14
1.125.000	Invesco CLO Ltd Series 2021-3X Class D	8,67 %	22.10.2034	1.094.676	0,28
365.000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2016-NINE Class A	2,85 %	06.09.2038	337.474	0,09
130.000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust Series 2016-NINE Class B	2,85 %	06.09.2038	115.176	0,03
65.000	JP Morgan Mortgage Trust Series 2023-HE3 Class M2	7,84 %	25.05.2054	65.162	0,02
160.000	MetroNet Infrastructure Issuer LLC Series 2022-1A Class A2	6,35 %	20.10.2052	157.657	0,04
580.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C	4,28 %	15.06.2050	484.741	0,13
279.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4 Class C	5,06 %	15.12.2051	234.364	0,06
703.508	OBX Trust Series 2023-NQM7 Class A1	6,84 %	25.04.2063	717.682	0,18
500.000	Octagon Investment Partners 35 Ltd Series 2018-1X Class C	8,18 %	20.01.2031	480.659	0,12
340.000	Shops at Crystals Trust Series 2016-CSTL Class A	3,13 %	05.07.2036	317.390	0,08
12.884	SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC Class A2FX	2,65 %	25.09.2040	12.403	0,00
131.691	SoFi Professional Loan Program 2017-E LLC Class B	3,49 %	26.11.2040	126.833	0,03
150.000	Taco Bell Funding LLC Series 2016-1A Class A23	4,97 %	25.05.2046	148.184	0,04

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 5,92 % (31. Dezember 2022: 6,10 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
585.788	Taco Bell Funding LLC Series 2018-1A Class A2II	4,94 %	25.11.2048	571.926	0,15
2.000.000	TCW CLO Ltd Series 2018-1X Class D	8,55 %	25.04.2031	1.943.401	0,50
1.000.000	Trinitas CLO VII Ltd Series 2017-7X Class D1R	9,14 %	25.01.2035	933.393	0,24
1.000.000	Trinitas CLO XIX Ltd Series 2022-19X Class E	13,38 %	23.10.2033	941.672	0,24
390.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 Class C	4,68 %	15.12.2048	358.529	0,09
550.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class C	4,39 %	15.11.2049	479.673	0,12
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **			**23.118.219**	**5,92**
	Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %)				
	Euro				
350.000	888 Acquisitions Ltd**	7,56 %	15.07.2027	370.096	0,09
800.000	Abertis Infraestructuras Finance BV*	3,25 %	29.12.2049	850.492	0,22
500.000	Ahlstrom Holding 3 Oy*	3,63 %	04.02.2028	501.923	0,13
700.000	Allwyn International AS**	3,88 %	15.02.2027	746.191	0,19
300.000	Altice Financing SA**	4,25 %	15.08.2029	295.004	0,08
300.000	Altice Finco SA*	4,75 %	15.01.2028	276.169	0,07
300.000	Altice France Holding SA*	8,00 %	15.05.2027	191.068	0,05
200.000	Altice France SA**	4,25 %	15.10.2029	176.625	0,05
800.000	American Tower Corp*	0,50 %	15.01.2028	788.837	0,20
186.000	APA Infrastructure Ltd*	7,13 %	09.11.2083	216.275	0,06
415.000	Avis Budget Finance Plc**	7,25 %	31.07.2030	492.144	0,13
600.000	Banco Santander SA*	4,13 %	29.12.2049	569.265	0,15
512.000	Banijay Entertainment SASU**	7,00 %	01.05.2029	598.033	0,15
700.000	Bayer AG*	5,38 %	25.03.2082	736.907	0,19
1.399.000	BCP V Modular Services Finance Plc**	6,75 %	30.11.2029	1.273.625	0,33
400.000	Benteler International AG*	9,38 %	15.05.2028	473.132	0,12
1.000.000	Birkenstock Financing Sarl*	5,25 %	30.04.2029	1.101.710	0,28
900.000	BPCE SA*	5,13 %	25.01.2035	1.025.007	0,26
500.000	CECONOMY AG*	1,75 %	24.06.2026	481.336	0,12
500.000	Cirsa Finance International Sarl*	4,50 %	15.03.2027	533.109	0,14
599.000	Cirsa Finance International Sarl*	10,38 %	30.11.2027	723.286	0,19
1.400.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	4,38 %	15.05.2026	1.538.699	0,39
600.000	Commerzbank AG*	6,50 %	29.12.2049	631.334	0,16
1.000.000	Ctec II GmbH**	5,25 %	15.02.2030	992.555	0,25
801.000	Dana Financing Luxembourg Sarl*	8,50 %	15.07.2031	970.652	0,25
600.000	Deutsche Lufthansa AG*	3,00 %	29.05.2026	646.561	0,17
200.000	Deutsche Lufthansa AG*	3,50 %	14.07.2029	215.653	0,06
1.200.000	Digital Dutch Finco BV*	1,25 %	01.02.2031	1.111.333	0,28
1.000.000	Dufry One BV**	2,50 %	15.10.2024	1.089.036	0,28

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
1.000.000	Electricite de France SA*	5,00 %	29.12.2049	1.105.389	0,28
200.000	Electricite de France SA*	7,50 %	29.12.2049	241.753	0,06
699.000	Emerald Debt Merger Sub LLC*	6,38 %	15.12.2030	827.785	0,21
503.000	Emeria SASU**	3,38 %	31.03.2028	478.578	0,12
794.000	Energia Group Roi Financeco DAC**	6,88 %	31.07.2028	912.682	0,23
333.000	Ephios Subco 3 Sarl**	7,88 %	31.01.2031	381.341	0,10
1.430.000	Fastighets AB Balder*	2,87 %	02.06.2081	1.196.287	0,31
500.000	Forvia SE*	3,75 %	15.06.2028	542.537	0,14
447.000	Forvia SE*	7,25 %	15.06.2026	524.626	0,13
929.000	Gruenenthal GmbH**	4,13 %	15.05.2028	1.018.069	0,26
1.250.000	Guala Closures SpA*	3,25 %	15.06.2028	1.302.619	0,33
1.300.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	0,75 %	06.09.2029	948.644	0,24
615.000	HSBC Holdings Plc*	4,75 %	29.12.2049	616.026	0,16
1.102.000	IHO Verwaltungs GmbH*	8,75 %	15.05.2028	1.329.212	0,34
1.500.000	Iliad Holding SASU**	5,63 %	15.10.2028	1.667.596	0,43
478.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc*	8,50 %	15.03.2029	558.725	0,14
500.000	International Consolidated Airlines Group SA*	3,75 %	25.03.2029	535.429	0,14
350.000	Intrum AB*	4,88 %	15.08.2025	362.665	0,09
501.000	IPD 3 BV*	8,00 %	15.06.2028	592.213	0,15
1.102.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50 %	15.07.2028	1.191.910	0,31
300.000	Kapla Holding SAS*	9,47 %	15.07.2027	338.479	0,09
450.000	Kronos International Inc**	3,75 %	15.09.2025	478.374	0,12
520.000	LHMC Finco 2 Sarl*	7,25 %	02.10.2025	572.336	0,15
900.000	Liberty Mutual Group Inc*	4,63 %	02.12.2030	1.042.587	0,27
1.500.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	1.621.250	0,42
752.000	Lottomatica SpA**	7,13 %	01.06.2028	877.661	0,22
1.160.000	Loxam SAS*	5,75 %	15.07.2027	1.264.864	0,32
200.000	Loxam SAS*	6,38 %	31.05.2029	229.382	0,06
500.000	Lune Holdings Sarl**	5,63 %	15.11.2028	452.052	0,12
986.000	Motion Bondco DAC*	4,50 %	15.11.2027	992.209	0,25
480.000	Motion Finco Sarl*	7,38 %	15.06.2030	543.319	0,14
700.000	Olympus Water US Holding Corp*	3,88 %	01.10.2028	710.814	0,18
859.000	Olympus Water US Holding Corp*	5,38 %	01.10.2029	814.364	0,21
226.000	Paprec Holding SA**	6,50 %	17.11.2027	267.434	0,07
415.000	Petroleos Mexicanos*	4,88 %	21.02.2028	400.712	0,10
500.000	PEU Finance Plc*	7,25 %	01.07.2028	569.732	0,15
602.000	Playtech Plc*	5,88 %	28.06.2028	664.437	0,17
1.000.000	Schaeffler AG*	3,38 %	12.10.2028	1.072.653	0,27
400.000	SES SA*	2,88 %	29.12.2049	403.035	0,10

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
135.158	Summer BC Holdco A Sarl**	9,25 %	31.10.2027	133.964	0,03
350.000	Summer BC Holdco B Sarl**	5,75 %	31.10.2026	371.278	0,09
750.000	TeamSystem SpA*	3,50 %	15.02.2028	769.533	0,20
439.599	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**	6,00 %	30.07.2026	485.982	0,12
1.250.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**	2,00 %	15.07.2025	1.353.925	0,35
700.000	Telecom Italia SpA**	3,00 %	30.09.2025	756.429	0,19
878.000	Telecom Italia SpA*	7,88 %	31.07.2028	1.079.877	0,28
1.000.000	Telefonica Europe BV*	4,38 %	29.12.2049	1.098.663	0,28
500.000	Telefonica Europe BV*	6,14 %	29.12.2049	569.279	0,15
500.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	3,75 %	09.05.2027	533.611	0,14
307.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	7,38 %	15.09.2029	372.027	0,10
307.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	7,88 %	15.09.2031	385.181	0,10
450.000	Titan Holdings II BV*	5,13 %	15.07.2029	428.131	0,11
630.000	TK Elevator Holdco GmbH**	6,63 %	15.07.2028	644.500	0,16
200.000	TMNL Holding BV**	3,75 %	15.01.2029	210.303	0,05
300.000	United Group BV**	4,63 %	15.08.2028	314.995	0,08
800.000	Verisure Holding AB*	3,25 %	15.02.2027	850.486	0,22
1.201.000	Verisure Midholding AB*	5,25 %	15.02.2029	1.270.044	0,33
400.000	Wp/ap Telecom Holdings III BV**	5,50 %	15.01.2030	404.706	0,10
900.000	ZF Europe Finance BV*	3,00 %	23.10.2029	917.757	0,23
1.000.000	ZF Finance GmbH*	3,75 %	21.09.2028	1.068.415	0,27
	Euro insgesamt			**63.284.923**	**16,20**
	Britisches Pfund				
500.000	AA Bond Co Ltd*	6,50 %	31.01.2026	608.956	0,16
400.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	4,75 %	15.07.2027	372.053	0,10
900.000	Barclays Plc*	6,37 %	31.01.2031	1.192.103	0,31
500.000	Bellis Acquisition Co Plc**	3,25 %	16.02.2026	593.248	0,15
700.000	Castle UK Finco Plc**	7,00 %	15.05.2029	760.497	0,19
501.000	Constellation Automotive Financing Plc*	4,88 %	15.07.2027	526.983	0,13
998.000	CPUK Finance Ltd**	6,50 %	28.08.2026	1.233.892	0,32
750.000	Encore Capital Group Inc*	4,25 %	01.06.2028	821.594	0,21
595.000	Mobico Group Plc*	4,25 %	29.12.2049	671.676	0,17
700.000	Nationwide Building Society*	5,75 %	29.12.2049	825.320	0,21
800.000	NatWest Group Plc*	5,13 %	29.12.2049	918.643	0,23
581.000	Pinnacle Bidco Plc*	10,00 %	11.10.2028	771.677	0,20
750.000	Travis Perkins Plc*	3,75 %	17.02.2026	904.471	0,23
402.000	TVL Finance Plc*	10,25 %	28.04.2028	533.951	0,14
	Britisches Pfund insgesamt			**10.735.064**	**2,75**

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar				
725.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	4,00 %	15.10.2030	651.144	0,17
450.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	5,38 %	18.07.2028	457.133	0,12
257.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC**	8,00 %	29.12.2049	273.511	0,07
251.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC*	4,70 %	24.04.2033	254.759	0,06
400.000	Adani Green Energy Ltd*	4,38 %	08.09.2024	386.482	0,10
500.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**	4,38 %	03.07.2029	438.948	0,11
875.000	Adient Global Holdings Ltd**	7,00 %	15.04.2028	904.979	0,23
2.585.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	3,30 %	30.01.2032	2.250.701	0,58
297.000	Agrosuper SA**	4,60 %	20.01.2032	255.637	0,07
1.170.000	Ahead DB Holdings LLC**	6,63 %	01.05.2028	1.020.538	0,26
1.245.781	Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust**	5,25 %	01.04.2029	1.222.779	0,31
1.200.000	Air Lease Corp*	4,63 %	01.10.2028	1.173.954	0,30
1.261.978	Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**	4,80 %	15.08.2027	1.228.118	0,31
1.780.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	6,50 %	15.02.2028	1.802.380	0,46
282.228	Alfa Desarrollo SpA**	4,55 %	27.09.2051	220.612	0,06
1.000.000	Alfa SAB de CV**	6,88 %	25.03.2044	997.776	0,26
333.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,20 %	06.12.2047	272.201	0,07
467.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,40 %	06.12.2057	380.849	0,10
1.730.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.04.2028	1.770.923	0,45
750.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**	6,00 %	01.06.2029	612.224	0,16
229.000	Ally Financial Inc**	4,70 %	29.12.2049	155.939	0,04
145.000	Ally Financial Inc Series B**	4,70 %	29.12.2049	109.212	0,03
500.000	Alsea SAB de CV**	7,75 %	14.12.2026	510.896	0,13
915.000	Altice France Holding SA**	6,00 %	15.02.2028	440.302	0,11
1.210.000	American Airlines Inc**	7,25 %	15.02.2028	1.224.937	0,31
2.615.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,75 %	20.04.2029	2.551.998	0,65
1.125.000	AmWINS Group Inc**	4,88 %	30.06.2029	1.028.879	0,26
2.960.000	APX Group Inc**	5,75 %	15.07.2029	2.763.275	0,71
785.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	3,25 %	01.09.2028	687.643	0,18
365.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	5,25 %	15.08.2027	283.985	0,07
1.425.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	5,88 %	30.06.2029	1.327.285	0,34
1.620.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	8,25 %	31.12.2028	1.631.309	0,42
850.000	AssuredPartners Inc**	5,63 %	15.01.2029	794.460	0,20
2.007.000	AT&T Inc**	3,65 %	15.09.2059	1.440.156	0,37
985.000	AthenaHealth Group Inc**	6,50 %	15.02.2030	894.885	0,23
1.070.000	Avient Corp**	7,13 %	01.08.2030	1.113.762	0,28
175.000	Azul Secured Finance LLP**	10,88 %	28.05.2030	144.827	0,04
725.000	Banco Davivienda SA**	6,65 %	29.12.2049	519.281	0,13
300.000	Banco de Bogota SA*	6,25 %	12.05.2026	296.440	0,08
500.000	Banco de Credito e Inversiones SA**	2,88 %	14.10.2031	424.340	0,11

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
520.000	Banco do Brasil SA**	6,25 %	18.04.2030	541.468	0,14
300.000	Banco Mercantil del Norte SA**	6,63 %	29.12.2049	255.600	0,07
600.000	Bangkok Bank PCL**	5,00 %	29.12.2049	574.992	0,15
300.000	Bank Hapoalim BM*	3,26 %	21.01.2032	260.787	0,07
905.000	Bank of America Corp**	5,08 %	20.01.2027	903.383	0,23
750.000	Barclays Plc*	4,38 %	29.12.2049	584.929	0,15
2.340.000	Bath & Body Works Inc**	6,63 %	01.10.2030	2.393.099	0,61
400.000	Bidvest Group UK Plc*	3,63 %	23.09.2026	372.000	0,10
410.000	BOC Aviation USA Corp**	4,88 %	03.05.2033	401.692	0,10
2.550.000	Boeing Co*	5,81 %	01.05.2050	2.642.441	0,68
695.000	Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC 144A**	10,00 %	15.11.2028	726.275	0,19
500.000	Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**	10,00 %	15.11.2028	522.500	0,13
1.600.000	BPCE SA**	3,12 %	19.10.2032	1.306.068	0,33
2.400.000	Broadcom Inc**	3,19 %	15.11.2036	1.946.175	0,50
385.000	BroadStreet Partners Inc**	5,88 %	15.04.2029	359.699	0,09
305.000	Buckeye Partners LP**	5,85 %	15.11.2043	247.556	0,06
605.000	Caesars Entertainment Inc**	4,63 %	15.10.2029	546.458	0,14
1.085.000	Caesars Entertainment Inc**	8,13 %	01.07.2027	1.112.976	0,28
685.000	Calpine Corp**	5,00 %	01.02.2031	628.848	0,16
980.000	Calpine Corp**	5,13 %	15.03.2028	940.215	0,24
1.500.000	Camelot Return Merger Sub Inc**	8,75 %	01.08.2028	1.524.486	0,39
742.000	Canacol Energy Ltd**	5,75 %	24.11.2028	541.836	0,14
261.000	Capital One Financial Corp**	3,95 %	29.12.2049	209.828	0,05
570.000	Carnival Corp**	7,63 %	01.03.2026	580.662	0,15
1.370.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd**	10,38 %	01.05.2028	1.492.196	0,38
626.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00 %	29.12.2049	541.240	0,14
1.930.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,00 %	01.02.2028	1.848.096	0,47
850.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,38 %	01.06.2029	802.384	0,21
2.000.000	CDW LLC/CDW Finance Corp**	3,28 %	01.12.2028	1.837.126	0,47
200.000	Cemex SAB de CV**	5,13 %	29.12.2049	189.836	0,05
500.000	Cemex SAB de CV**	5,45 %	19.11.2029	493.469	0,13
445.000	Cemex SAB de CV**	9,13 %	29.12.2049	474.481	0,12
1.595.000	Centene Corp*	2,50 %	01.03.2031	1.331.061	0,34
333.000	Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**	5,25 %	27.04.2029	313.066	0,08
1.670.000	Chart Industries Inc**	7,50 %	01.01.2030	1.747.650	0,45
870.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80 %	01.03.2050	674.559	0,17
1.550.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	5,75 %	01.04.2048	1.377.656	0,35
1.685.000	Cheniere Energy Partners LP**	3,25 %	31.01.2032	1.437.738	0,37
670.000	Churchill Downs Inc**	4,75 %	15.01.2028	642.544	0,16
340.000	Churchill Downs Inc**	6,75 %	01.05.2031	345.503	0,09

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
905.000	Citigroup Inc**	5,61 %	29.09.2026	912.263	0,23
1.310.000	Civitas Resources Inc**	8,63 %	01.11.2030	1.390.653	0,36
625.000	Civitas Resources Inc**	8,75 %	01.07.2031	666.123	0,17
1.935.000	CommScope Technologies LLC**	5,00 %	15.03.2027	807.253	0,21
400.000	Compania de Minas Buenaventura SAA**	5,50 %	23.07.2026	382.217	0,10
3.216.000	Comstock Resources Inc**	6,75 %	01.03.2029	2.945.123	0,75
410.000	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC**	4,75 %	15.01.2029	391.400	0,10
1.485.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	5,50 %	15.06.2031	1.409.279	0,36
195.000	Crown Castle Towers LLC**	4,24 %	15.07.2028	185.180	0,05
1.510.000	CSC Holdings LLC**	4,13 %	01.12.2030	1.150.499	0,29
2.165.000	CSC Holdings LLC**	4,63 %	01.12.2030	1.306.297	0,33
300.000	CSC Holdings LLC**	5,25 %	01.06.2024	293.892	0,08
500.000	CSN Resources SA**	4,63 %	10.06.2031	409.303	0,10
220.000	CSN Resources SA**	8,88 %	05.12.2030	229.464	0,06
355.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC**	8,88 %	01.09.2031	376.486	0,10
785.000	Dana Inc*	4,50 %	15.02.2032	683.888	0,17
1.150.000	Dell International LLC/EMC Corp*	6,20 %	15.07.2030	1.234.459	0,32
2.125.000	Discovery Communications LLC**	4,00 %	15.09.2055	1.514.642	0,39
820.000	DT Midstream Inc**	4,38 %	15.06.2031	740.697	0,19
350.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,13 %	30.06.2028	303.275	0,08
735.000	Ecopetrol SA**	4,63 %	02.11.2031	624.310	0,16
200.000	Ecopetrol SA*	8,88 %	13.01.2033	217.531	0,06
550.000	Edison International**	5,00 %	29.12.2049	513.482	0,13
400.000	EIG Pearl Holdings Sarl*	4,39 %	30.11.2046	322.160	0,08
305.000	Emerald Debt Merger Sub LLC**	6,63 %	15.12.2030	311.899	0,08
400.000	Emirates NBD Bank PJSC**	4,25 %	29.12.2049	361.000	0,09
720.000	Emirates NBD Bank PJSC*	5,88 %	11.10.2028	745.229	0,19
438.000	Empresa Nacional del Petroleo**	3,45 %	16.09.2031	369.631	0,09
241.773	Energian Israel Finance Ltd**	4,88 %	30.03.2026	223.459	0,06
1.810.000	Energizer Holdings Inc**	4,75 %	15.06.2028	1.675.313	0,43
500.000	ENN Energy Holdings Ltd**	2,63 %	17.09.2030	428.238	0,11
2.400.000	EPR Properties**	3,60 %	15.11.2031	1.992.761	0,51
425.000	EQM Midstream Partners LP**	4,75 %	15.01.2031	396.095	0,10
390.000	EQM Midstream Partners LP*	5,50 %	15.07.2028	386.670	0,10
1.145.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2030	1.232.202	0,32
900.000	EquipmentShare.com Inc**	9,00 %	15.05.2028	927.090	0,24
299.000	First Abu Dhabi Bank PJSC*	6,32 %	04.04.2034	308.426	0,08
455.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	01.03.2026	407.883	0,10
150.000	First Quantum Minerals Ltd**	8,63 %	01.06.2031	127.313	0,03
485.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	5,88 %	15.04.2030	481.231	0,12

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
3.405.000	Ford Motor Credit Co LLC*	7,20 %	10.06.2030	3.630.226	0,93
600.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25 %	23.07.2029	390.880	0,10
1.050.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,00 %	01.05.2028	971.352	0,25
475.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88 %	15.10.2027	459.292	0,12
1.000.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00 %	15.12.2025	1.026.211	0,26
403.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63 %	31.03.2036	333.316	0,09
1.600.000	General Motors Co*	5,00 %	01.04.2035	1.528.724	0,39
1.000.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00 %	15.01.2027	1.017.305	0,26
455.000	Global Infrastructure Solutions Inc**	7,50 %	15.04.2032	420.319	0,11
905.000	Goldman Sachs Group Inc**	1,43 %	09.03.2027	834.731	0,21
1.565.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,25 %	15.07.2031	1.421.889	0,36
1.170.000	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	1.057.680	0,27
200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl*	6,51 %	23.02.2042	211.505	0,05
500.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC**	7,50 %	15.01.2031	528.686	0,14
339.289	Guara Norte Sarl**	5,20 %	15.06.2034	309.466	0,08
585.000	Harvest Midstream I LP**	7,50 %	01.09.2028	582.174	0,15
1.600.000	HCA Inc*	5,25 %	15.06.2049	1.489.386	0,38
614.000	HDFC Bank Ltd**	3,70 %	29.12.2049	560.305	0,14
280.000	Howard Midstream Energy Partners LLC**	8,88 %	15.07.2028	294.182	0,08
905.000	HSBC Holdings Plc*	7,39 %	03.11.2028	970.324	0,25
445.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,25 %	07.11.2027	406.739	0,10
1.100.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	4,50 %	29.05.2029	975.535	0,25
1.550.000	HUB International Ltd**	7,25 %	15.06.2030	1.638.203	0,42
1.094.000	Hudbay Minerals Inc**	6,13 %	01.04.2029	1.074.104	0,27
252.000	Huntington Bancshares Inc**	4,45 %	29.12.2049	221.631	0,06
68.000	Huntington Bancshares Inc**	5,63 %	29.12.2049	61.734	0,02
200.000	Hyundai Capital America**	5,68 %	26.06.2028	204.000	0,05
680.000	IHO Verwaltungs GmbH**	4,75 %	15.09.2026	652.096	0,17
500.000	IHS Holding Ltd**	5,63 %	29.11.2026	436.493	0,11
715.000	Imola Merger Corp**	4,75 %	15.05.2029	680.214	0,17
600.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT**	3,54 %	27.04.2032	519.689	0,13
630.000	INEOS Finance Plc*	6,75 %	15.05.2028	619.433	0,16
250.000	ING Groep NV**	3,88 %	29.12.2049	203.437	0,05
1.005.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC**	6,00 %	15.09.2028	938.740	0,24
350.000	Investment Energy Resources Ltd*	6,25 %	26.04.2029	330.955	0,08
365.000	Iron Mountain Inc**	5,63 %	15.07.2032	346.391	0,09
950.000	ITT Holdings LLC**	6,50 %	01.08.2029	841.382	0,22
670.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	5,88 %	15.01.2028	662.026	0,17
1.195.000	JELD-WEN Inc**	4,88 %	15.12.2027	1.130.530	0,29
500.000	JSW Steel Ltd*	5,05 %	05.04.2032	431.770	0,11

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
400.000	KazMunayGas National Co JSC*	3,50 %	14.04.2033	333.430	0,09
800.000	KazMunayGas National Co JSC*	6,38 %	24.10.2048	753.148	0,19
2.400.000	KB Home**	7,25 %	15.07.2030	2.487.271	0,64
1.000.000	Kinder Morgan Energy Partners LP*	5,50 %	01.03.2044	949.172	0,24
500.000	Klabin Austria GmbH**	3,20 %	12.01.2031	419.201	0,11
500.000	Kosmos Energy Ltd*	7,13 %	04.04.2026	477.153	0,12
555.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25 %	01.07.2029	484.127	0,12
450.000	Lenovo Group Ltd*	3,42 %	02.11.2030	397.675	0,10
410.000	Level 3 Financing Inc**	4,63 %	15.09.2027	247.792	0,06
535.000	Level 3 Financing Inc**	10,50 %	15.05.2030	511.125	0,13
250.000	Leviathan Bond Ltd*	6,75 %	30.06.2030	228.889	0,06
325.000	Light & Wonder International Inc**	7,50 %	01.09.2031	339.213	0,09
350.000	Longfor Group Holdings Ltd**	3,95 %	16.09.2029	162.236	0,04
1.775.000	Macy's Retail Holdings LLC**	5,88 %	15.03.2030	1.688.797	0,43
735.000	Madison IAQ LLC**	5,88 %	30.06.2029	648.501	0,17
600.000	MARB BondCo Plc*	3,95 %	29.01.2031	487.905	0,12
1.350.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,88 %	15.08.2026	1.375.084	0,35
676.376	MC Brazil Downstream Trading Sarl**	7,25 %	30.06.2031	530.915	0,14
910.000	McAfee Corp**	7,38 %	15.02.2030	832.274	0,21
720.000	McGraw-Hill Education Inc**	8,00 %	01.08.2029	670.291	0,17
201.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	5,88 %	01.05.2034	219.752	0,06
700.000	Medco Oak Tree Pte Ltd**	7,38 %	14.05.2026	695.912	0,18
1.595.000	Medline Borrower LP**	3,88 %	01.04.2029	1.444.040	0,37
300.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63 %	17.07.2027	281.435	0,07
355.000	Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS*	8,25 %	15.11.2028	371.142	0,09
1.635.000	Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp**	4,88 %	01.05.2029	1.522.357	0,39
300.000	Minerva Luxembourg SA**	8,88 %	13.09.2033	317.713	0,08
400.000	Minsur SA**	4,50 %	28.10.2031	353.972	0,09
330.000	Molina Healthcare Inc**	3,88 %	15.11.2030	297.010	0,08
905.000	Morgan Stanley**	4,21 %	20.04.2028	884.985	0,23
1.150.000	MPLX LP*	5,50 %	15.02.2049	1.113.859	0,28
1.770.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,00 %	15.10.2027	1.447.403	0,37
385.000	Nabors Industries Inc**	7,38 %	15.05.2027	377.586	0,10
1.600.000	NatWest Group Plc*	3,03 %	28.11.2035	1.328.584	0,34
340.000	Neptune Bidco US Inc**	9,29 %	15.04.2029	317.328	0,08
2.945.000	New Fortress Energy Inc**	6,50 %	30.09.2026	2.831.052	0,72
820.000	Newfold Digital Holdings Group Inc**	6,00 %	15.02.2029	620.355	0,16
500.000	Nexa Resources SA**	5,38 %	04.05.2027	488.499	0,12
670.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	10,75 %	01.06.2028	677.175	0,17
555.000	NRG Energy Inc**	3,38 %	15.02.2029	490.811	0,13

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
118.000	NRG Energy Inc**	3,88 %	15.02.2032	101.153	0,03
595.000	NRG Energy Inc**	10,25 %	29.12.2049	620.038	0,16
265.000	Olympus Water US Holding Corp**	9,75 %	15.11.2028	281.600	0,07
1.465.000	OneMain Finance Corp*	3,88 %	15.09.2028	1.297.352	0,33
400.000	OneMain Finance Corp*	9,00 %	15.01.2029	423.232	0,11
272.000	Oryx Funding Ltd**	5,80 %	03.02.2031	273.428	0,07
300.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63 %	24.04.2028	314.363	0,08
475.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	5,88 %	01.10.2028	467.588	0,12
500.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	493.870	0,13
690.000	Permian Resources Operating LLC**	7,00 %	15.01.2032	712.368	0,18
635.000	Petrobras Global Finance BV*	5,50 %	10.06.2051	535.919	0,14
429.000	Petrobras Global Finance BV*	6,50 %	03.07.2033	435.968	0,11
1.475.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**	7,75 %	15.02.2029	1.436.131	0,37
475.000	Pilgrim's Pride Corp**	3,50 %	01.03.2032	402.190	0,10
520.000	Pilgrim's Pride Corp**	6,25 %	01.07.2033	535.691	0,14
1.020.000	Pilgrim's Pride Corp**	6,88 %	15.05.2034	1.102.450	0,28
220.000	PNC Financial Services Group Inc**	3,40 %	29.12.2049	176.533	0,04
830.000	PNC Financial Services Group Inc**	4,76 %	26.01.2027	823.788	0,21
500.000	Power Finance Corp Ltd*	4,50 %	18.06.2029	485.189	0,12
1.350.000	Presidio Holdings Inc**	8,25 %	01.02.2028	1.365.258	0,35
295.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75 %	15.04.2026	296.784	0,08
3.170.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25 %	15.01.2028	3.153.987	0,81
500.000	Prosus NV*	3,83 %	08.02.2051	314.498	0,08
1.240.000	Rackspace Technology Global Inc**	3,50 %	15.02.2028	499.230	0,13
1.190.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,25 %	15.04.2030	889.683	0,23
409.000	Rede D'or Finance Sarl**	4,50 %	22.01.2030	371.069	0,09
649.000	Reliance Industries Ltd*	3,63 %	12.01.2052	476.935	0,12
450.000	ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries**	4,50 %	14.07.2028	400.323	0,10
185.000	RingCentral Inc**	8,50 %	15.08.2030	189.363	0,05
825.000	Ritchie Bros Holdings Inc**	7,75 %	15.03.2031	880.572	0,23
235.000	Rockcliff Energy II LLC**	5,50 %	15.10.2029	222.417	0,06
700.000	Rogers Communications Inc**	3,80 %	15.03.2032	644.378	0,16
360.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	01.04.2028	355.638	0,09
905.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	7,25 %	15.01.2030	945.730	0,24
700.000	Samarco Mineracao SA**	9,50 %	30.06.2031	588.700	0,15
1.000.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50 %	27.09.2028	953.733	0,24
327.000	Sasol Financing USA LLC*	8,75 %	03.05.2029	333.972	0,09
700.000	SEPLAT Energy Plc*	7,75 %	01.04.2026	645.400	0,17
2.000	Service Properties Trust**	3,95 %	15.01.2028	1.641	0,00
705.000	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**	4,75 %	01.04.2029	652.294	0,17

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
318.000	Shelf Drilling Holdings Ltd**	9,63 %	15.04.2029	311.420	0,08
1.300.000	SierraCol Energy Andina LLC**	6,00 %	15.06.2028	1.095.172	0,28
402.000	Sitios Latinoamerica SAB de CV**	5,38 %	04.04.2032	374.080	0,10
266.000	SK Hynix Inc*	6,38 %	17.01.2028	274.934	0,07
225.000	SK Hynix Inc*	6,50 %	17.01.2033	237.724	0,06
380.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63 %	01.04.2026	385.587	0,10
483.000	Standard Chartered Plc*	6,30 %	06.07.2034	507.589	0,13
1.555.000	Standard Industries Inc**	3,38 %	15.01.2031	1.340.038	0,34
2.480.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp**	9,00 %	15.10.2026	2.462.850	0,63
990.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	31.12.2030	921.717	0,24
295.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	01.09.2031	273.278	0,07
1.155.000	Team Health Holdings Inc†	13,50 %	30.06.2028	1.131.900	0,29
600.000	Telecomunicaciones Digitales SA**	4,50 %	30.01.2030	517.740	0,13
750.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24 %	03.06.2050	500.780	0,13
1.515.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	01.10.2028	1.512.046	0,39
200.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75 %	18.06.2050	141.107	0,04
500.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75 %	18.06.2050	352.767	0,09
615.000	TMS International Corp**	6,25 %	15.04.2029	508.208	0,13
282.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV*	6,38 %	20.09.2028	114.924	0,03
2.390.000	TransDigm Inc**	6,75 %	15.08.2028	2.448.153	0,63
200.000	Transnet SOC Ltd*	8,25 %	06.02.2028	201.973	0,05
820.000	Trivium Packaging Finance BV*	8,50 %	15.08.2027	804.936	0,21
45.000	Truist Financial Corp**	5,10 %	29.12.2049	41.004	0,01
830.000	Truist Financial Corp**	6,05 %	08.06.2027	845.034	0,22
400.000	Trust Fibra Uno**	6,95 %	30.01.2044	345.520	0,09
300.000	Turk Telekomunikasyon AS*	4,88 %	19.06.2024	295.125	0,08
300.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*	5,80 %	11.04.2028	285.288	0,07
200.000	Turkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50 %	18.10.2024	196.978	0,05
1.293.967	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**	5,88 %	15.10.2027	1.311.558	0,34
605.000	United Airlines Inc**	4,38 %	15.04.2026	589.990	0,15
1.410.000	United Rentals North America Inc*	5,25 %	15.01.2030	1.389.930	0,36
855.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	10,50 %	15.02.2028	867.534	0,22
220.000	US Foods Inc**	6,88 %	15.09.2028	226.734	0,06
255.000	US Foods Inc**	7,25 %	15.01.2032	266.210	0,07
635.000	Valaris Ltd**	8,38 %	30.04.2030	651.126	0,17
645.000	Vale Overseas Ltd*	6,88 %	21.11.2036	704.455	0,18
1.000.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95 %	11.03.2025	744.540	0,19
500.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	441.890	0,11
890.000	Venture Global LNG Inc**	8,38 %	01.06.2031	890.879	0,23
410.000	Venture Global LNG Inc**	9,50 %	01.02.2029	434.105	0,11

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 75,85 % (31. Dezember 2022: 80,14 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
245.000	Venture Global LNG Inc**	9,88 %	01.02.2032	255.355	0,07
965.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	6,38 %	01.02.2030	674.710	0,17
735.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	9,50 %	01.06.2028	622.940	0,16
2.115.000	Vistra Corp**	7,00 %	29.12.2049	2.086.173	0,53
1.025.000	Vistra Operations Co LLC**	7,75 %	15.10.2031	1.065.322	0,27
200.000	VTR Finance NV**	6,38 %	15.07.2028	52.362	0,01
340.000	WE Soda Investments Holding Plc**	9,50 %	06.10.2028	351.832	0,09
905.000	Wells Fargo & Co**	4,54 %	15.08.2026	895.900	0,23
1.205.000	White Cap Buyer LLC**	6,88 %	15.10.2028	1.167.960	0,30
405.000	Windsor Holdings III LLC**	8,50 %	15.06.2030	423.743	0,11
500.000	XP Inc**	3,25 %	01.07.2026	469.183	0,12
660.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS**	9,25 %	16.10.2028	700.791	0,18
300.000	YPF SA*	6,95 %	21.07.2027	268.732	0,07
700.000	YPF SA*	8,50 %	28.07.2025	676.616	0,17
	US-Dollar insgesamt			**222.253.475**	**56,90**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**296.273.462**	**75,85**
	Staatsanleihen 3,94 % (31. Dezember 2022: 2,49 %)				
	Euro				
1.350.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,88 %	17.10.2040	1.252.226	0,32
904.000	Republic of Cameroon International Bond*	5,95 %	07.07.2032	739.865	0,19
	Euro insgesamt			**1.992.091**	**0,51**
	US-Dollar				
1.250.000	Angolan Government International Bond*	8,25 %	09.05.2028	1.155.419	0,30
1.002.000	Angolan Government International Bond*	8,75 %	14.04.2032	883.986	0,23
250.000	Brazilian Government International Bond**	6,25 %	18.03.2031	259.775	0,07
401.000	Chile Government International Bond*	4,95 %	05.01.2036	397.261	0,10
436.000	Dominican Republic International Bond*	5,30 %	21.01.2041	378.230	0,10
800.000	Dominican Republic International Bond*	6,85 %	27.01.2045	800.000	0,20
928.000	Egypt Government International Bond*	7,50 %	16.02.2061	544.908	0,14
600.000	Egypt Government International Bond*	7,63 %	29.05.2032	418.583	0,11
1.000.000	Ghana Government International Bond*	10,75 %	14.10.2030	633.126	0,16
367.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS*	8,51 %	14.01.2029	389.754	0,10
500.000	Romanian Government International Bond*	7,13 %	17.01.2033	540.108	0,14
312.000	Romanian Government International Bond*	7,63 %	17.01.2053	350.575	0,09
400.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,88 %	25.07.2024	211.800	0,05
349.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	9,00 %	28.01.2027	363.882	0,09
591.000	Ukraine Government International Bond*	6,88 %	21.05.2031	137.821	0,03
1.000.000	Ukraine Government International Bond*	7,38 %	25.09.2034	237.550	0,06

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 3,94 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
459.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2028	128.482	0,03
417.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2029	115.637	0,03
1.000.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.08.2041	451.107	0,12
500.000	Ukraine Government International Bond*	9,75 %	01.11.2030	145.000	0,04
5.080.000	United States Treasury Note/Bond*	3,88 %	15.05.2043	4.844.653	1,24
	US-Dollar insgesamt			**13.387.657**	**3,43**
	Staatsanleihen insgesamt			**15.379.748**	**3,94**
	Mittelfristige Schuldverschreibungen^ 3,87 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
	US-Dollar				
497.442	AlixPartners LLP	8,22 %	04.02.2028	499.121	0,13
992.386	Alterra Mountain Co	8,97 %	17.08.2028	995.075	0,25
995.000	AppLovin Corp	8,46 %	19.08.2030	997.005	0,25
992.386	APX Group Inc	8,93 %	10.07.2028	994.247	0,25
995.000	Aramark Intermediate HoldCo Corp	7,97 %	22.06.2030	998.572	0,26
994.987	Central Parent LLC	9,35 %	06.07.2029	1.001.773	0,26
1.406.318	CQP Holdco LP	8,35 %	31.12.2030	1.411.275	0,36
1.000.000	Flexera Software LLC	0,00 %	07.12.2028	1.000.705	0,26
498.649	Great Outdoors Group LLC	9,22 %	06.03.2028	499.272	0,13
743.003	Ingram Micro Inc	8,61 %	30.06.2028	746.253	0,19
992.424	Medline Borrower LP	8,47 %	23.10.2028	998.548	0,26
997.494	Select Medical Corp	8,36 %	06.03.2027	999.364	0,26
1.000.000	Star Parent Inc	9,35 %	27.09.2030	990.695	0,25
991.552	UFC Holdings LLC	8,40 %	29.04.2026	996.440	0,25
976.245	William Morris Endeavor Entertainment LLC	8,22 %	18.05.2025	980.062	0,25
992.500	World Wide Technology Holding Co LLC	8,71 %	01.03.2030	997.467	0,26
	Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †			**15.105.874**	**3,87**

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Investmentfonds 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)		
	Britisches Pfund		
75.108	NB Global Monthly Income Fund Ltd	66.832	0,01
	Investmentfonds insgesamt ‡	**66.832**	**0,01**
	Anlagen insgesamt	**355.966.218**	**91,13**

Devisenterminkontrakte 2,08 % (31. Dezember 2022: 7,36 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
1.011.841 €	1.075.997 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	42.429	0,01

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 2,08 % (31. Dezember 2022: 7,36 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
5.732.223 €	6.139.857 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	2	196.184	0,05
1.051.738 £	1.307.452 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	33.421	0,01
699.821 £	873.782 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	18.428	0,00
1.416.078 £	1.738.678 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	66.697	0,02
1.190.276 US$	1.074.358 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	2.748	0,00
Abgesicherte Klassen CAD						
1.041.907 CAD	769.666 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	11	20.676	0,01
13.801.783 CAD	10.169.497 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	299.883	0,08
Abgesicherte Klassen EUR						
174.959 €	190.318 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	3.071	0,00
3.761.426 €	4.005.083 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	152.563	0,04
4.097.812 €	4.374.465 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	17	154.999	0,04
Abgesicherte Klassen GBP						
1.160.874 £	1.466.911 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	13.101	0,00
76.382.127 £	93.941.509 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	6	3.438.964	0,88
80.875.291 £	99.421.599 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	9	3.687.263	0,94
177.169 US$	138.657 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	393	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**8.130.820**	**2,08**

Futures-Kontrakte 0,96 % (31. Dezember 2022: 0,12 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
39	Euro-Bund Future March 2024	167.155	0,05
77	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024	165.617	0,04
1.385	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	3.400.967	0,87
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**3.733.739**	**0,96**

Total Return Swap-Kontrakte 0,07 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Nominalwert		Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
USD	15.998.663	20.03.2024	5,38[1]	iBoxx USD Liquid High Yield Index[2]	149.106	0,04
USD	12.498.955	20.03.2024	5,38[1]	iBoxx USD Liquid High Yield Index[2]	119.157	0,03
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten ∞					**268.263**	**0,07**

[1] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

[2] Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die JPMorgan Chase Bank.

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**368.099.040**	**94,24**

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,89 %) (31. Dezember 2022: (2,75 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
737 US$	1.000 CAD	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(22)	(0,00)
14.464.690 US$	11.784.003 £	18.01.2024	Royal Bank of Canada	2	(558.874)	(0,15)
1.143.674 US$	1.038.019 €	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(3.688)	(0,00)
68.050.995 US$	63.863.637 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(2.539.881)	(0,65)
Abgesicherte Klassen CAD						
57.101 US$	78.076 CAD	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(2.124)	(0,00)
69.046 US$	94.467 CAD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(2.613)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
56.359 €	62.514 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(218)	(0,00)
96.257 US$	90.816 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(4.125)	(0,00)
3.538.985 US$	3.212.904 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	16	(12.360)	(0,00)
Abgesicherte Klassen GBP						
912.716 £	1.167.469 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(3.836)	(0,00)
2.198.466 US$	1.808.803 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(107.599)	(0,03)
6.158.583 US$	4.997.131 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	19	(212.318)	(0,06)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(3.447.658)**	**(0,89)**

Futures-Kontrakte (1,32 %) (31. Dezember 2022: (0,13 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
(474)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	(1.767.716)	(0,45)
(117)	US Treasury 10-Year Ultra Future March 2024	(671.836)	(0,17)
(69)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024	(693.774)	(0,18)
(158)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	(2.039.897)	(0,52)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(5.173.223)**	**(1,32)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(8.620.881)**	**(2,21)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**359.478.159**	**92,03**
Sonstiges Nettovermögen	**31.134.822**	**7,97**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**390.612.981**	**100,00**

^ Schuldverschreibungen mit einem Zinssatz von 0,00 %, wurden zum 31. Dezember 2023 eventuell noch nicht abgerechnet und haben somit keinen gültigen Zinssatz. Die Zinssätze werden erst bei Abrechnung gültig.

Global Flexible Credit Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

	Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	126.213.779	31,32
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	213.447.833	52,95
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	16.237.774	4,03
µ	Investmentfonds	66.832	0,02
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(1.439.484)	(0,36)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	4.951.425	1,23
Anlagen insgesamt		**359.478.159**	**89,19**

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %)				
	Euro				
1.600.000	Abertis Infraestructuras Finance BV*	3,25 %	29.12.2049	1.700.984	0,30
200.000	Accor SA*	7,25 %	29.12.2049	240.914	0,04
228.962	Adient Global Holdings Ltd*	3,50 %	15.08.2024	251.134	0,05
600.000	Ahlstrom Holding 3 Oy*	3,63 %	04.02.2028	602.308	0,11
1.152.000	Altice Financing SA**	4,25 %	15.08.2029	1.132.816	0,20
500.000	Altice France Holding SA*	8,00 %	15.05.2027	318.447	0,06
200.000	Altice France SA**	2,13 %	15.02.2025	213.654	0,04
250.000	Altice France SA**	4,13 %	15.01.2029	221.497	0,04
983.000	Altice France SA**	4,25 %	15.10.2029	868.111	0,16
186.000	APA Infrastructure Ltd*	7,13 %	09.11.2083	216.275	0,04
868.000	Aramark International Finance Sarl*	3,13 %	01.04.2025	956.709	0,17
1.049.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	2,13 %	15.08.2026	1.035.884	0,19
1.228.000	Ashland Services BV**	2,00 %	30.01.2028	1.263.754	0,23
841.000	Assemblin Group AB**	8,96 %	05.07.2029	945.055	0,17
250.000	Avantor Funding Inc*	3,88 %	15.07.2028	271.259	0,05
1.072.000	Avis Budget Finance Plc**	7,25 %	31.07.2030	1.271.275	0,23
654.000	Azelis Finance NV*	5,75 %	15.03.2028	749.456	0,13
776.000	Banijay Entertainment SASU**	7,00 %	01.05.2029	906.394	0,16
750.000	Banijay Group SAS**	6,50 %	01.03.2026	829.659	0,15
525.000	Benteler International AG*	9,38 %	15.05.2028	620.986	0,11
1.098.000	Birkenstock Financing Sarl*	5,25 %	30.04.2029	1.209.678	0,22
439.000	Boels Topholding BV**	6,25 %	15.02.2029	507.997	0,09
1.000.000	Canpack SA/Canpack US LLC*	2,38 %	01.11.2027	1.015.406	0,18
580.000	Castle UK Finco Plc**	9,25 %	15.05.2028	594.999	0,11
1.100.000	CECONOMY AG*	1,75 %	24.06.2026	1.058.939	0,19
495.000	Cerba Healthcare SACA*	3,50 %	31.05.2028	459.207	0,08
335.000	Cerved Group SpA*	6,00 %	15.02.2029	338.790	0,06
1.210.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH**	7,50 %	15.05.2030	1.427.400	0,26
1.891.000	Constellium SE*	3,13 %	15.07.2029	1.927.264	0,34
1.075.000	Coty Inc**	3,88 %	15.04.2026	1.187.835	0,21
640.000	CPI Property Group SA*	1,75 %	14.01.2030	404.132	0,07
495.000	Cullinan Holdco Scsp**	4,63 %	15.10.2026	427.435	0,08
901.000	Dana Financing Luxembourg Sarl*	8,50 %	15.07.2031	1.091.832	0,19
700.000	Deutsche Lufthansa AG*	3,50 %	14.07.2029	754.787	0,13
1.100.000	Deutsche Lufthansa AG*	3,75 %	11.02.2028	1.201.533	0,22
500.000	Dometic Group AB*	3,00 %	08.05.2026	545.169	0,10
1.065.000	Douglas GmbH*	6,00 %	08.04.2026	1.165.784	0,21
575.000	doValue SpA*	3,38 %	31.07.2026	574.183	0,10
543.000	Dufry One BV*	3,38 %	15.04.2028	573.749	0,10

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
475.000	Elior Group SA*	3,75 %	15.07.2026	486.904	0,09
491.000	Emerald Debt Merger Sub LLC**	6,38 %	15.12.2030	581.463	0,11
299.000	Emeria SASU**	3,38 %	31.03.2028	284.483	0,05
1.083.000	Enel SpA*	6,38 %	29.12.2049	1.253.679	0,23
1.030.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50 %	30.06.2029	984.143	0,18
501.000	Ephios Subco 3 Sarl**	7,88 %	31.01.2031	573.729	0,10
1.065.000	Fiber Bidco SpA*	9,89 %	25.10.2027	1.198.628	0,22
250.000	Fiber Bidco SpA*	11,00 %	25.10.2027	302.200	0,05
1.313.000	Forvia SE*	2,75 %	15.02.2027	1.391.350	0,25
400.000	Forvia SE*	7,25 %	15.06.2026	469.464	0,08
1.230.000	Guala Closures SpA**	7,93 %	29.06.2029	1.380.603	0,25
1.020.000	Heimstaden Bostad AB*	3,25 %	29.12.2049	591.984	0,11
740.000	Iliad Holding SASU**	5,13 %	15.10.2026	816.909	0,15
2.030.000	Iliad Holding SASU**	5,63 %	15.10.2028	2.256.813	0,40
1.051.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc*	8,50 %	15.03.2029	1.228.494	0,22
800.000	Infineon Technologies AG*	2,88 %	29.12.2049	864.684	0,16
400.000	Infineon Technologies AG*	3,63 %	29.12.2049	425.332	0,08
700.000	International Consolidated Airlines Group SA*	3,75 %	25.03.2029	749.601	0,14
521.111	Intrum AB*	3,13 %	15.07.2024	566.229	0,10
654.000	IPD 3 BV*	8,00 %	15.06.2028	773.069	0,14
396.000	IQVIA Inc**	2,88 %	15.06.2028	418.079	0,07
495.000	Italmatch Chemicals SpA*	10,00 %	06.02.2028	566.544	0,10
400.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50 %	15.07.2028	432.635	0,08
655.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	6,88 %	15.11.2026	774.758	0,14
405.000	Kaixo Bondco Telecom SA*	5,13 %	30.09.2029	420.540	0,07
1.230.000	Koninklijke KPN NV*	6,00 %	29.12.2049	1.411.177	0,25
2.978.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	3.218.721	0,58
200.000	Loxam SAS*	4,50 %	15.04.2027	210.672	0,04
683.000	Loxam SAS*	5,75 %	15.07.2027	744.743	0,13
712.000	Loxam SAS*	6,38 %	15.05.2028	821.039	0,15
585.000	Monitchem HoldCo 3 SA*	8,75 %	01.05.2028	661.840	0,12
720.000	Motion Bondco DAC*	4,50 %	15.11.2027	724.534	0,13
604.000	Motion Finco Sarl*	7,38 %	15.06.2030	683.677	0,12
1.627.000	Multiversity SRL*	8,20 %	30.10.2028	1.808.499	0,32
374.000	NH Hotel Group SA*	4,00 %	02.07.2026	409.747	0,07
2.134.000	Novelis Sheet Ingot GmbH*	3,38 %	15.04.2029	2.230.715	0,40
1.122.000	Olympus Water US Holding Corp*	5,38 %	01.10.2029	1.063.698	0,19
1.120.000	Olympus Water US Holding Corp*	9,63 %	15.11.2028	1.329.924	0,24
224.000	Paprec Holding SA**	6,50 %	17.11.2027	265.067	0,05

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
513.000	PCF GmbH*	4,75 %	15.04.2026	415.669	0,07
689.000	Piaggio & C SpA*	6,50 %	05.10.2030	805.056	0,14
960.000	PLT VII Finance Sarl**	4,63 %	05.01.2026	1.057.298	0,19
955.000	Q-Park Holding I BV**	1,50 %	01.03.2025	1.035.895	0,19
800.000	RCS & RDS SA*	3,25 %	05.02.2028	792.052	0,14
300.000	SNF Group SACA*	2,63 %	01.02.2029	305.300	0,05
820.000	Standard Industries Inc**	2,25 %	21.11.2026	858.951	0,15
229.768	Summer BC Holdco A Sarl**	9,25 %	31.10.2027	227.740	0,04
905.000	Summer BC Holdco B Sarl**	5,75 %	31.10.2026	960.019	0,17
880.000	TDC Net A/S*	5,06 %	31.05.2028	1.011.438	0,18
800.949	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**	6,00 %	30.07.2026	885.459	0,16
847.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**	2,00 %	15.07.2025	917.419	0,16
1.811.000	Telecom Italia SpA*	2,88 %	28.01.2026	1.940.440	0,35
300.000	Telecom Italia SpA*	6,88 %	15.02.2028	353.761	0,07
1.102.000	Telecom Italia SpA*	7,88 %	31.07.2028	1.355.381	0,24
1.400.000	Telefonica Europe BV*	4,38 %	29.12.2049	1.538.128	0,28
200.000	Telefonica Europe BV*	6,14 %	29.12.2049	227.712	0,04
1.500.000	Telefonica Europe BV*	7,13 %	29.12.2049	1.792.971	0,32
325.000	TI Automotive Finance Plc**	3,75 %	15.04.2029	330.148	0,06
1.697.000	TK Elevator Midco GmbH**	4,38 %	15.07.2027	1.818.561	0,33
885.000	Trivium Packaging Finance BV*	3,75 %	15.08.2026	949.047	0,17
740.000	United Group BV**	5,25 %	01.02.2030	776.864	0,14
400.000	Valeo SE*	5,88 %	12.04.2029	474.889	0,08
1.300.000	Veolia Environnement SA*	2,25 %	29.12.2049	1.359.732	0,24
2.441.000	Verisure Holding AB*	3,88 %	15.07.2026	2.652.886	0,47
400.000	Verisure Midholding AB*	5,25 %	15.02.2029	422.995	0,08
200.000	Virgin Media Finance Plc**	3,75 %	15.07.2030	203.512	0,04
700.000	WMG Acquisition Corp*	2,25 %	15.08.2031	680.432	0,12
1.100.000	ZF Europe Finance BV*	3,00 %	23.10.2029	1.121.703	0,20
800.000	ZF Finance GmbH*	3,75 %	21.09.2028	854.732	0,15
1.660.000	Ziggo Bond Co BV*	3,38 %	28.02.2030	1.553.407	0,28
	Euro insgesamt			**96.138.657**	**17,23**
	Britisches Pfund				
741.000	AA Bond Co Ltd*	6,50 %	31.01.2026	902.473	0,16
240.000	AA Bond Co Ltd*	7,38 %	31.07.2029	306.874	0,05
735.000	B&M European Value Retail SA*	8,13 %	15.11.2030	1.000.107	0,18
1.447.000	Bellis Acquisition Co Plc**	3,25 %	16.02.2026	1.716.861	0,31
100.000	Bellis Finco Plc**	4,00 %	16.02.2027	111.338	0,02
794.000	British Telecommunications Plc*	8,38 %	20.12.2083	1.071.372	0,19

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	Britisches Pfund (Fortsetzung)				
200.000	Castle UK Finco Plc**	7,00 %	15.05.2029	217.285	0,04
800.000	Co-operative Group Holdings 2011 Ltd*	7,50 %	08.07.2026	1.008.919	0,18
1.163.000	CPUK Finance Ltd**	6,50 %	28.08.2026	1.437.892	0,26
213.000	Iceland Bondco Plc**	10,88 %	15.12.2027	284.164	0,05
658.000	Maison Finco Plc**	6,00 %	31.10.2027	728.083	0,13
1.374.000	Mobico Group Plc*	4,25 %	29.12.2049	1.551.063	0,28
590.000	Pinewood Finance Co Ltd**	3,25 %	30.09.2025	732.911	0,13
726.000	Pinnacle Bidco Plc*	10,00 %	11.10.2028	964.265	0,17
790.000	RAC Bond Co Plc**	5,25 %	04.11.2027	883.992	0,16
575.000	Rolls-Royce Plc*	5,75 %	15.10.2027	737.591	0,13
300.000	Travis Perkins Plc*	3,75 %	17.02.2026	361.788	0,06
416.000	TVL Finance Plc**	10,25 %	28.04.2028	552.546	0,10
2.044.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88 %	15.07.2028	2.404.829	0,43
610.000	Zenith Finco Plc**	6,50 %	30.06.2027	634.704	0,11
	Britisches Pfund insgesamt			**17.609.057**	**3,14**
	US-Dollar				
2.210.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	4,00 %	15.10.2030	1.984.865	0,36
640.000	180 Medical Inc**	3,88 %	15.10.2029	577.168	0,11
1.020.000	Acadia Healthcare Co Inc**	5,50 %	01.07.2028	1.005.744	0,18
692.000	Access Bank Plc*	6,13 %	21.09.2026	624.634	0,11
280.000	Acushnet Co**	7,38 %	15.10.2028	292.296	0,05
1.180.000	Adani Green Energy Ltd*	4,38 %	08.09.2024	1.140.121	0,21
400.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ*	6,25 %	10.12.2024	395.759	0,07
40.000	ADT Security Corp**	4,13 %	01.08.2029	36.854	0,01
1.795.000	ADT Security Corp**	4,88 %	15.07.2032	1.662.341	0,30
810.000	AerCap Global Aviation Trust*	6,50 %	15.06.2045	812.179	0,15
1.300.000	Ahead DB Holdings LLC**	6,63 %	01.05.2028	1.133.931	0,20
1.000.000	Akbank TAS**	6,80 %	06.02.2026	1.006.095	0,18
705.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	3,50 %	15.03.2029	640.952	0,11
410.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	4,63 %	15.01.2027	398.859	0,07
500.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	4,88 %	15.02.2030	479.208	0,09
585.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	5,88 %	15.02.2028	585.758	0,11
820.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	6,50 %	15.02.2028	830.310	0,15
40.000	Allegheny Technologies Inc*	4,88 %	01.10.2029	37.337	0,01
950.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	4,25 %	15.10.2027	913.829	0,16
2.220.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.10.2027	2.214.450	0,40
240.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.04.2028	245.677	0,04
555.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	7,00 %	15.01.2031	585.797	0,11
340.000	Ally Financial Inc*	5,80 %	01.05.2025	340.589	0,06

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.487.000	Alsea SAB de CV**	7,75 %	14.12.2026	1.519.405	0,27
370.000	Altice Financing SA**	5,00 %	15.01.2028	335.687	0,06
640.000	Altice Financing SA**	5,75 %	15.08.2029	568.796	0,10
2.205.000	Altice France SA*	5,50 %	15.01.2028	1.817.725	0,33
995.000	Altice France SA**	5,50 %	15.10.2029	781.457	0,14
535.000	American Airlines Inc**	7,25 %	15.02.2028	541.605	0,10
1.987.500	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50 %	20.04.2026	1.974.624	0,35
2.520.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,75 %	20.04.2029	2.459.287	0,44
420.000	Amkor Technology Inc**	6,63 %	15.09.2027	425.617	0,08
970.000	Amsted Industries Inc**	5,63 %	01.07.2027	967.491	0,17
165.000	AmWINS Group Inc**	4,88 %	30.06.2029	150.682	0,03
1.240.000	AmWINS Group Inc 144A**	4,88 %	30.06.2029	1.134.053	0,20
1.165.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,38 %	15.06.2029	1.121.375	0,20
930.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75 %	01.03.2027	923.361	0,17
2.475.000	APX Group Inc**	5,75 %	15.07.2029	2.310.508	0,41
35.000	APX Group Inc**	6,75 %	15.02.2027	34.962	0,01
690.000	Aramark Services Inc**	5,00 %	01.02.2028	669.790	0,12
825.000	Archrock Partners LP/Archrock Partners Finance Corp**	6,88 %	01.04.2027	827.879	0,15
1.125.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	4,00 %	01.09.2029	953.703	0,17
255.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	6,00 %	15.06.2027	254.246	0,05
935.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	5,25 %	15.08.2027	727.467	0,13
760.000	Arsenal AIC Parent LLC**	8,00 %	01.10.2030	793.904	0,14
445.000	Asbury Automotive Group Inc**	4,63 %	15.11.2029	412.391	0,07
3.970.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	5,88 %	30.06.2029	3.697.770	0,66
395.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	7,00 %	01.11.2026	398.098	0,07
2.735.000	ASGN Inc**	4,63 %	15.05.2028	2.599.965	0,47
985.000	Ashland Inc**	3,38 %	01.09.2031	850.767	0,15
1.770.000	AssuredPartners Inc**	5,63 %	15.01.2029	1.654.345	0,29
3.585.000	AthenaHealth Group Inc**	6,50 %	15.02.2030	3.257.017	0,58
35.000	ATI Inc*	5,88 %	01.12.2027	34.533	0,01
1.525.000	ATI Inc*	7,25 %	15.08.2030	1.588.473	0,28
480.000	ATS Corp**	4,13 %	15.12.2028	441.807	0,08
960.000	Avantor Funding Inc**	4,63 %	15.07.2028	928.523	0,16
1.950.000	Avient Corp**	7,13 %	01.08.2030	2.029.753	0,36
685.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	8,00 %	15.02.2031	684.647	0,12
570.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV**	7,25 %	15.02.2031	598.490	0,11
400.000	Axis Bank Ltd*	4,10 %	29.12.2049	365.433	0,06
175.000	Azul Secured Finance LLP**	10,88 %	28.05.2030	144.827	0,03
1.216.000	Banco Davivienda SA**	6,65 %	29.12.2049	870.960	0,16
1.800.000	Banco Mercantil del Norte SA*	7,50 %	29.12.2049	1.700.479	0,30

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
616.000	Bancolombia SA*	4,63 %	18.12.2029	571.485	0,10
910.000	Banijay Entertainment SASU**	8,13 %	01.05.2029	937.769	0,17
1.170.000	Bath & Body Works Inc**	6,63 %	01.10.2030	1.196.550	0,21
480.000	Bath & Body Works Inc*	6,75 %	01.07.2036	483.692	0,09
455.000	Bausch Health Cos Inc**	5,50 %	01.11.2025	416.641	0,07
160.000	Bausch Health Cos Inc**	5,75 %	15.08.2027	103.379	0,02
305.000	Bausch Health Cos Inc**	6,13 %	01.02.2027	206.198	0,04
260.000	Bausch Health Cos Inc**	9,00 %	15.12.2025	243.225	0,04
1.843.000	BBVA Bancomer SA**	5,88 %	13.09.2034	1.738.875	0,31
1.910.000	BCPE Empire Holdings Inc**	7,63 %	01.05.2027	1.843.725	0,33
390.000	Beacon Roofing Supply Inc**	4,13 %	15.05.2029	355.952	0,06
575.000	Beacon Roofing Supply Inc**	4,50 %	15.11.2026	560.733	0,10
765.000	Beacon Roofing Supply Inc**	6,50 %	01.08.2030	782.776	0,14
1.225.000	Benteler International AG**	10,50 %	15.05.2028	1.291.426	0,23
500.000	Berry Global Inc**	4,50 %	15.02.2026	487.657	0,09
865.000	Berry Global Inc**	5,63 %	15.07.2027	859.417	0,15
616.000	Bidvest Group UK Plc*	3,63 %	23.09.2026	572.880	0,10
430.000	Blackstone Mortgage Trust Inc**	3,75 %	15.01.2027	382.841	0,07
1.090.000	Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**	6,63 %	15.07.2026	1.084.436	0,19
200.000	Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**	10,00 %	15.11.2028	209.000	0,04
1.325.000	BroadStreet Partners Inc**	5,88 %	15.04.2029	1.237.926	0,22
65.000	Buckeye Partners LP**	4,13 %	01.03.2025	63.460	0,01
750.000	Buckeye Partners LP 144A**	4,13 %	01.03.2025	727.993	0,13
620.000	Buckeye Partners LP**	4,50 %	01.03.2028	584.687	0,10
450.000	Buckeye Partners LP**	5,85 %	15.11.2043	365.247	0,06
40.000	Builders FirstSource Inc**	5,00 %	01.03.2030	38.669	0,01
505.000	Builders FirstSource Inc**	6,38 %	15.06.2032	516.229	0,09
1.015.000	Cable One Inc**	4,00 %	15.11.2030	823.046	0,15
1.095.000	Calderys Financing LLC**	11,25 %	01.06.2028	1.148.261	0,21
850.000	Calpine Corp**	4,63 %	01.02.2029	790.327	0,14
1.760.000	Camelot Return Merger Sub Inc**	8,75 %	01.08.2028	1.788.730	0,32
1.128.000	Canacol Energy Ltd**	5,75 %	24.11.2028	823.707	0,15
1.255.000	Carpenter Technology Corp*	6,38 %	15.07.2028	1.251.759	0,22
35.000	Carpenter Technology Corp*	7,63 %	15.03.2030	36.140	0,01
500.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00 %	29.12.2049	432.300	0,08
970.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	3,13 %	15.02.2029	849.963	0,15
250.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	3,50 %	01.04.2030	217.757	0,04
835.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,50 %	01.06.2033	707.610	0,13
405.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,75 %	01.02.2032	357.656	0,06
40.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,00 %	01.02.2028	38.302	0,01

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.565.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,13 %	01.05.2027	1.513.034	0,27
190.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,50 %	01.05.2026	188.853	0,03
2.175.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	6,38 %	01.09.2029	2.147.797	0,39
1.015.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	7,38 %	01.03.2031	1.042.394	0,19
430.000	Cedar Fair LP**	5,25 %	15.07.2029	406.161	0,07
1.345.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	6,50 %	01.10.2028	1.336.819	0,24
614.000	Cemex SAB de CV**	5,13 %	29.12.2049	582.798	0,10
945.000	Cemex SAB de CV**	9,13 %	29.12.2049	1.007.502	0,18
1.700.000	Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**	5,25 %	27.04.2029	1.600.227	0,29
185.000	Central Parent Inc/CDK Global Inc**	7,25 %	15.06.2029	188.810	0,03
150.000	Central Parent LLC/CDK Global II LLC/CDK Financing Co Inc**	8,00 %	15.06.2029	156.680	0,03
1.860.000	Chart Industries Inc**	7,50 %	01.01.2030	1.946.485	0,35
200.000	Chart Industries Inc**	9,50 %	01.01.2031	217.400	0,04
45.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,25 %	15.05.2030	37.698	0,01
180.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,63 %	15.03.2027	167.480	0,03
255.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,00 %	15.01.2029	229.824	0,04
500.000	Ciena Corp**	4,00 %	31.01.2030	455.928	0,08
820.000	Civitas Resources Inc**	8,38 %	01.07.2028	857.060	0,15
3.200.000	Civitas Resources Inc**	8,63 %	01.11.2030	3.397.014	0,61
220.000	Clearway Energy Operating LLC**	3,75 %	15.01.2032	191.918	0,04
1.735.000	Clearway Energy Operating LLC**	4,75 %	15.03.2028	1.672.859	0,30
1.290.000	CommScope Inc**	4,75 %	01.09.2029	867.326	0,15
1.135.000	CommScope Inc**	7,13 %	01.07.2028	540.243	0,10
500.000	Compania de Minas Buenaventura SAA**	5,50 %	23.07.2026	477.771	0,09
2.030.000	Comstock Resources Inc**	5,88 %	15.01.2030	1.763.350	0,32
1.656.000	Comstock Resources Inc**	6,75 %	01.03.2029	1.516.519	0,27
435.000	Consensus Cloud Solutions Inc**	6,50 %	15.10.2028	395.017	0,07
1.700.000	Constellium SE**	5,63 %	15.06.2028	1.661.050	0,30
549.010	Continuum Energy Levanter Pte Ltd**	4,50 %	09.02.2027	516.683	0,09
725.000	Cornerstone Building Brands Inc**	6,13 %	15.01.2029	595.243	0,11
590.000	Coty Inc**	5,00 %	15.04.2026	581.048	0,10
285.000	Coty Inc**	6,50 %	15.04.2026	284.867	0,05
435.000	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC**	6,63 %	15.07.2030	447.152	0,08
2.770.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	5,50 %	15.06.2031	2.628.756	0,47
925.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	7,50 %	15.12.2033	959.722	0,17
1.240.000	CSC Holdings LLC**	4,50 %	15.11.2031	939.053	0,17
540.000	CSC Holdings LLC**	5,25 %	01.06.2024	529.006	0,10
1.455.000	CSC Holdings LLC**	5,38 %	01.02.2028	1.286.618	0,23
1.115.000	CSC Holdings LLC**	5,50 %	15.04.2027	1.031.338	0,19
105.000	CSC Holdings LLC**	5,75 %	15.01.2030	65.472	0,01

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
3.000.000	CSC Holdings LLC 144A**	5,75 %	15.01.2030	1.870.620	0,34
535.000	CSC Holdings LLC**	11,25 %	15.05.2028	551.620	0,10
730.000	CSN Resources SA**	4,63 %	10.06.2031	597.945	0,11
220.000	CSN Resources SA**	8,88 %	05.12.2030	229.464	0,04
800.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC**	6,75 %	15.05.2028	796.812	0,14
1.285.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC**	8,88 %	01.09.2031	1.362.775	0,25
1.575.000	Dana Inc*	4,50 %	15.02.2032	1.372.131	0,25
820.000	Dana Inc*	5,38 %	15.11.2027	815.080	0,15
115.000	Dana Inc*	5,63 %	15.06.2028	113.485	0,02
540.000	DaVita Inc**	3,75 %	15.02.2031	444.355	0,08
335.000	DaVita Inc**	4,63 %	01.06.2030	292.748	0,05
925.000	Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**	8,00 %	01.02.2028	916.828	0,16
500.000	Ecopetrol SA**	5,88 %	28.05.2045	395.463	0,07
1.093.000	Ecopetrol SA**	6,88 %	29.04.2030	1.084.460	0,19
709.000	Ecopetrol SA*	8,88 %	13.01.2033	771.148	0,14
1.065.000	Element Solutions Inc**	3,88 %	01.09.2028	981.522	0,17
430.000	Embraer Netherlands Finance BV**	7,00 %	28.07.2030	451.498	0,08
835.000	Emerald Debt Merger Sub LLC**	6,63 %	15.12.2030	853.887	0,15
650.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13 %	29.12.2049	647.185	0,12
1.335.000	Encompass Health Corp*	4,50 %	01.02.2028	1.278.528	0,23
205.000	Encompass Health Corp*	4,63 %	01.04.2031	188.880	0,03
990.000	Endeavor Energy Resources LP/EER Finance Inc**	5,75 %	30.01.2028	991.553	0,18
300.000	Endeavour Mining Plc**	5,00 %	14.10.2026	278.064	0,05
400.000	Energian Israel Finance Ltd**	5,38 %	30.03.2028	352.517	0,06
2.645.000	Energizer Holdings Inc**	6,50 %	31.12.2027	2.647.727	0,47
1.000.000	EnerSys**	4,38 %	15.12.2027	950.625	0,17
770.000	EnLink Midstream LLC**	6,50 %	01.09.2030	787.025	0,14
400.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38 %	12.05.2026	375.357	0,07
1.320.000	Enviri Corp**	5,75 %	31.07.2027	1.231.791	0,22
835.000	EQM Midstream Partners LP**	6,50 %	01.07.2027	850.746	0,15
200.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2027	206.204	0,04
265.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2030	285.182	0,05
2.110.000	EquipmentShare.com Inc**	9,00 %	15.05.2028	2.173.511	0,39
230.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	01.03.2026	206.182	0,04
800.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	15.10.2027	681.000	0,12
880.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50 %	01.04.2025	839.877	0,15
315.000	First Quantum Minerals Ltd**	8,63 %	01.06.2031	267.356	0,05
975.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	5,88 %	15.04.2030	967.422	0,17
720.000	Ford Motor Co*	3,25 %	12.02.2032	599.127	0,11
2.040.000	Ford Motor Credit Co LLC*	2,90 %	10.02.2029	1.788.273	0,32

Global DG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
890.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,13 %	17.08.2027	843.323	0,15
580.000	Ford Motor Credit Co LLC*	6,80 %	12.05.2028	606.203	0,11
215.000	Ford Motor Credit Co LLC*	7,35 %	04.11.2027	226.875	0,04
490.000	Ford Motor Credit Co LLC**	8,37 %	06.03.2026	503.367	0,09
570.000	Fortrea Holdings Inc**	7,50 %	01.07.2030	586.087	0,11
400.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25 %	23.07.2029	260.587	0,05
2.690.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88 %	15.10.2027	2.601.045	0,47
1.040.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88 %	01.11.2029	879.974	0,16
35.000	Frontier Communications Holdings LLC**	8,75 %	15.05.2030	36.033	0,01
1.432.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00 %	15.12.2025	1.469.529	0,26
440.000	Gap Inc**	3,63 %	01.10.2029	376.739	0,07
455.000	Gen Digital Inc**	6,75 %	30.09.2027	463.169	0,08
685.000	Gen Digital Inc**	7,13 %	30.09.2030	716.606	0,13
970.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00 %	15.01.2027	986.786	0,17
975.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,25 %	15.01.2029	1.004.094	0,18
755.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,88 %	15.04.2030	781.503	0,14
40.000	GFL Environmental Inc**	3,50 %	01.09.2028	37.002	0,01
850.000	GFL Environmental Inc**	4,25 %	01.06.2025	837.971	0,15
330.000	Global Infrastructure Solutions Inc**	5,63 %	01.06.2029	301.752	0,05
815.000	Global Infrastructure Solutions Inc**	7,50 %	15.04.2032	752.879	0,14
370.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	4,88 %	15.03.2027	358.487	0,06
230.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00 %	31.05.2026	226.603	0,04
1.065.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00 %	15.07.2029	1.007.560	0,18
1.440.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,25 %	15.07.2031	1.308.319	0,23
25.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	9,50 %	31.05.2025	25.384	0,01
370.000	Greenko Dutch BV**	3,85 %	29.03.2026	345.367	0,06
903.600	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	816.854	0,14
3.050.000	GTCR AP Finance Inc**	8,00 %	15.05.2027	3.085.099	0,55
3.005.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC**	7,50 %	15.01.2031	3.177.404	0,57
1.600.000	GYP Holdings III Corp**	4,63 %	01.05.2029	1.469.917	0,26
1.070.000	Harvest Midstream I LP**	7,50 %	01.09.2028	1.064.832	0,19
1.090.000	Hertz Corp**	4,63 %	01.12.2026	978.236	0,18
1.215.000	Howard Midstream Energy Partners LLC**	6,75 %	15.01.2027	1.202.695	0,21
200.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	4,50 %	29.05.2029	177.370	0,03
200.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	198.250	0,03
950.000	HUB International Ltd**	5,63 %	01.12.2029	907.475	0,16
1.415.000	HUB International Ltd**	7,00 %	01.05.2026	1.422.110	0,25
1.460.000	HUB International Ltd**	7,25 %	15.06.2030	1.543.081	0,28
960.000	Hudbay Minerals Inc**	4,50 %	01.04.2026	930.861	0,17
1.265.000	Hudbay Minerals Inc**	6,13 %	01.04.2029	1.241.995	0,22

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
916.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00 %	18.09.2027	818.868	0,15
35.000	Iliad Holding SASU**	6,50 %	15.10.2026	34.956	0,01
1.060.000	Iliad Holding SASU**	7,00 %	15.10.2028	1.055.563	0,19
532.000	Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV Inc**	9,00 %	01.07.2028	509.337	0,09
1.220.000	INEOS Finance Plc*	6,75 %	15.05.2028	1.199.537	0,21
605.000	Iron Mountain Inc**	4,88 %	15.09.2029	573.645	0,11
770.000	Iron Mountain Inc**	5,63 %	15.07.2032	730.742	0,13
400.000	Itau Unibanco Holding SA*	3,88 %	15.04.2031	383.394	0,07
2.345.000	ITT Holdings LLC**	6,50 %	01.08.2029	2.076.884	0,37
1.020.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	5,50 %	15.07.2029	995.225	0,18
720.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	5,88 %	15.01.2028	711.431	0,13
675.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc**	7,75 %	15.10.2025	683.129	0,12
2.405.000	JELD-WEN Inc**	4,88 %	15.12.2027	2.275.250	0,41
524.000	JSW Steel Ltd*	5,05 %	05.04.2032	452.494	0,08
670.000	KB Home*	4,80 %	15.11.2029	641.297	0,12
410.000	KB Home*	6,88 %	15.06.2027	426.682	0,08
1.205.000	KB Home**	7,25 %	15.07.2030	1.248.818	0,22
985.000	Kinetik Holdings LP**	5,88 %	15.06.2030	967.636	0,17
700.000	Kosmos Energy Ltd*	7,13 %	04.04.2026	668.015	0,12
320.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2027	358.022	0,06
99.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2029	113.469	0,02
825.000	Latam Airlines Group SA 144A**	13,38 %	15.10.2029	945.575	0,17
170.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25 %	01.07.2029	148.308	0,03
1.715.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC 144A**	4,25 %	01.07.2029	1.495.996	0,27
2.010.000	Legacy LifePoint Health LLC**	4,38 %	15.02.2027	1.857.881	0,33
1.170.000	Level 3 Financing Inc**	4,25 %	01.07.2028	649.740	0,12
135.000	Level 3 Financing Inc**	4,63 %	15.09.2027	81.590	0,01
670.000	Level 3 Financing Inc 144A**	4,63 %	15.09.2027	404.929	0,07
940.000	Level 3 Financing Inc**	10,50 %	15.05.2030	898.051	0,16
350.000	Leviathan Bond Ltd*	6,75 %	30.06.2030	320.445	0,06
595.000	LifePoint Health Inc**	9,88 %	15.08.2030	602.045	0,11
35.000	Lindblad Expeditions Holdings Inc**	9,00 %	15.05.2028	36.346	0,01
770.000	Lindblad Expeditions LLC**	6,75 %	15.02.2027	766.804	0,14
1.195.000	Live Nation Entertainment Inc**	3,75 %	15.01.2028	1.117.436	0,20
70.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,75 %	15.10.2027	67.179	0,01
570.000	Live Nation Entertainment Inc 144A**	4,75 %	15.10.2027	547.029	0,10
35.000	Live Nation Entertainment Inc**	6,50 %	15.05.2027	35.635	0,01
485.000	Macy's Retail Holdings LLC*	4,50 %	15.12.2034	393.692	0,07
145.000	Macy's Retail Holdings LLC*	5,13 %	15.01.2042	113.307	0,02
360.000	Macy's Retail Holdings LLC**	5,88 %	01.04.2029	346.004	0,06

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
270.000	Macy's Retail Holdings LLC**	5,88 %	15.03.2030	256.887	0,05
25.000	Macy's Retail Holdings LLC**	6,13 %	15.03.2032	23.687	0,00
375.000	Madison IAQ LLC**	4,13 %	30.06.2028	341.303	0,06
1.895.000	Madison IAQ LLC**	5,88 %	30.06.2029	1.671.984	0,30
1.375.000	Manitowoc Co Inc**	9,00 %	01.04.2026	1.385.215	0,25
800.000	MARB BondCo Plc*	3,95 %	29.01.2031	650.480	0,11
1.070.000	Masonite International Corp**	3,50 %	15.02.2030	928.787	0,17
1.855.000	Masonite International Corp**	5,38 %	01.02.2028	1.783.323	0,32
515.000	Mattamy Group Corp**	4,63 %	01.03.2030	477.827	0,08
195.000	Mattamy Group Corp**	5,25 %	15.12.2027	189.808	0,03
850.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,88 %	15.08.2026	865.794	0,16
1.370.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	9,25 %	15.04.2027	1.346.217	0,24
1.623.338	MC Brazil Downstream Trading Sarl**	7,25 %	30.06.2031	1.274.223	0,23
945.000	McAfee Corp**	7,38 %	15.02.2030	864.284	0,15
750.000	McGraw-Hill Education Inc**	5,75 %	01.08.2028	723.952	0,13
50.000	McGraw-Hill Education Inc**	8,00 %	01.08.2029	46.548	0,01
765.000	McGraw-Hill Education Inc 144A**	8,00 %	01.08.2029	712.184	0,13
800.000	Medco Bell Pte Ltd**	6,38 %	30.01.2027	762.249	0,14
1.260.000	Medline Borrower LP**	3,88 %	01.04.2029	1.140.746	0,20
2.630.000	Medline Borrower LP**	5,25 %	01.10.2029	2.482.500	0,44
415.000	Meritage Homes Corp*	5,13 %	06.06.2027	409.390	0,07
375.000	Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS*	8,25 %	15.11.2028	392.051	0,07
570.000	Midcontinent Communications/Midcontinent Finance Corp**	5,38 %	15.08.2027	556.089	0,10
1.386.900	Millicom International Cellular SA*	6,25 %	25.03.2029	1.315.843	0,24
1.767.000	Minerva Luxembourg SA*	4,38 %	18.03.2031	1.458.485	0,27
1.900.000	Molina Healthcare Inc**	4,38 %	15.06.2028	1.798.833	0,32
960.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,00 %	15.10.2027	785.032	0,14
930.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,25 %	01.08.2026	832.427	0,15
745.000	Mueller Water Products Inc**	4,00 %	15.06.2029	679.521	0,12
395.000	Murphy Oil USA Inc*	4,75 %	15.09.2029	374.697	0,07
535.000	Nabors Industries Inc**	9,13 %	31.01.2030	537.635	0,10
1.645.000	Nabors Industries Ltd**	7,25 %	15.01.2026	1.582.852	0,28
40.000	Nabors Industries Ltd**	7,50 %	15.01.2028	34.631	0,01
1.130.000	NCL Corp Ltd**	5,88 %	15.02.2027	1.120.951	0,20
2.845.000	NCL Corp Ltd**	8,13 %	15.01.2029	2.973.970	0,53
345.000	NCL Finance Ltd**	6,13 %	15.03.2028	330.562	0,06
2.060.000	Nemak SAB de CV**	3,63 %	28.06.2031	1.712.835	0,31
1.950.000	Neptune Bidco US Inc**	9,29 %	15.04.2029	1.819.969	0,33
600.000	Network i2i Ltd*	5,65 %	29.12.2049	594.258	0,11
1.615.000	New Fortress Energy Inc**	6,50 %	30.09.2026	1.552.512	0,28

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.315.000	New Fortress Energy Inc**	6,75 %	15.09.2025	1.305.560	0,23
235.000	NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC**	7,13 %	01.04.2026	226.012	0,04
1.165.000	Northern Oil & Gas Inc**	8,13 %	01.03.2028	1.180.774	0,21
100.000	Northern Oil & Gas Inc**	8,75 %	15.06.2031	104.285	0,02
600.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	4,75 %	30.04.2027	573.477	0,10
40.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	6,00 %	15.02.2028	37.021	0,01
380.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	10,75 %	01.06.2028	384.069	0,07
278.000	NOVA Chemicals Corp**	4,88 %	01.06.2024	275.834	0,05
235.000	NOVA Chemicals Corp**	5,25 %	01.06.2027	220.604	0,04
35.000	NOVA Chemicals Corp**	8,50 %	15.11.2028	36.747	0,00
1.705.000	Novelis Corp**	4,75 %	30.01.2030	1.606.201	0,29
350.000	NuStar Logistics LP*	6,00 %	01.06.2026	349.697	0,06
455.000	Olympus Water US Holding Corp**	6,25 %	01.10.2029	404.627	0,07
1.010.000	Olympus Water US Holding Corp**	7,13 %	01.10.2027	1.011.914	0,18
795.000	Olympus Water US Holding Corp**	9,75 %	15.11.2028	844.801	0,15
890.000	OneMain Finance Corp*	3,50 %	15.01.2027	824.282	0,15
660.000	OneMain Finance Corp*	5,38 %	15.11.2029	618.987	0,11
555.000	OneMain Finance Corp*	6,63 %	15.01.2028	560.719	0,10
920.000	OneMain Finance Corp**	6,88 %	15.03.2025	932.038	0,17
130.000	OneMain Finance Corp**	7,13 %	15.03.2026	132.530	0,02
445.000	OneMain Finance Corp*	9,00 %	15.01.2029	470.845	0,09
1.160.000	Open Text Holdings Inc**	4,13 %	15.02.2030	1.051.122	0,19
1.767.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63 %	24.04.2028	1.851.597	0,33
1.075.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC**	4,00 %	15.10.2027	1.005.797	0,18
540.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc**	4,38 %	15.10.2028	505.383	0,09
1.193.000	Pampa Energia SA*	7,50 %	24.01.2027	1.165.747	0,21
1.565.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	5,88 %	01.10.2028	1.540.579	0,28
340.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	7,50 %	01.06.2025	342.138	0,06
1.335.000	Performance Food Group Inc**	4,25 %	01.08.2029	1.225.814	0,22
290.000	Performance Food Group Inc**	5,50 %	15.10.2027	286.057	0,05
400.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	395.096	0,07
40.000	Permian Resources Operating LLC**	5,88 %	01.07.2029	39.051	0,01
1.740.000	Permian Resources Operating LLC**	7,00 %	15.01.2032	1.796.407	0,32
1.429.000	Petrobras Global Finance BV*	6,50 %	03.07.2033	1.452.210	0,26
40.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**	4,75 %	15.02.2028	37.741	0,01
1.390.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**	7,75 %	15.02.2029	1.353.371	0,24
2.655.000	Presidio Holdings Inc**	8,25 %	01.02.2028	2.685.007	0,48
3.010.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75 %	15.04.2026	3.028.204	0,54
2.295.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25 %	15.01.2028	2.283.407	0,41
1.660.000	Rackspace Technology Global Inc**	3,50 %	15.02.2028	668.324	0,12

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
795.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,25 %	15.04.2030	594.368	0,11
925.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,75 %	15.01.2029	719.903	0,13
992.000	Rede D'or Finance Sarl**	4,50 %	22.01.2030	900.001	0,16
365.000	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc/LifePoint Health Inc**	9,75 %	01.12.2026	362.520	0,07
692.000	ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries**	4,50 %	14.07.2028	615.608	0,11
1.500.000	Resideo Funding Inc**	4,00 %	01.09.2029	1.310.700	0,23
605.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,50 %	15.02.2029	563.168	0,10
1.140.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,75 %	15.10.2027	1.101.953	0,20
835.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	7,25 %	15.07.2028	868.660	0,16
1.155.000	Ritchie Bros Holdings Inc**	6,75 %	15.03.2028	1.190.600	0,21
1.035.000	Ritchie Bros Holdings Inc**	7,75 %	15.03.2031	1.104.717	0,20
500.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd**	5,20 %	12.01.2026	130.370	0,02
565.000	RLJ Lodging Trust LP**	3,75 %	01.07.2026	535.763	0,09
635.000	RLJ Lodging Trust LP**	4,00 %	15.09.2029	571.280	0,10
165.000	RLJ Lodging Trust LP 144A**	4,00 %	15.09.2029	148.443	0,03
575.000	Rockcliff Energy II LLC**	5,50 %	15.10.2029	544.211	0,10
680.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,38 %	15.07.2027	673.571	0,12
660.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	31.08.2026	653.910	0,12
605.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	01.04.2028	597.670	0,10
1.665.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	8,25 %	15.01.2029	1.770.431	0,32
355.000	Royal Caribbean Cruises Ltd*	9,25 %	15.01.2029	382.079	0,07
770.000	Rumo Luxembourg Sarl**	5,25 %	10.01.2028	741.876	0,13
530.000	Ryan Specialty LLC**	4,38 %	01.02.2030	492.237	0,09
550.000	Samarco Mineracao SA**	9,50 %	30.06.2031	462.550	0,08
1.750.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50 %	27.09.2028	1.669.033	0,30
390.000	Sasol Financing USA LLC*	8,75 %	03.05.2029	398.316	0,07
890.000	SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC**	5,38 %	01.11.2026	855.394	0,15
1.135.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc**	5,25 %	15.08.2029	1.062.344	0,19
830.000	Select Medical Corp**	6,25 %	15.08.2026	834.685	0,15
1.030.000	Sensata Technologies BV**	4,00 %	15.04.2029	958.338	0,17
785.000	Sensata Technologies BV**	5,88 %	01.09.2030	780.746	0,14
1.349.000	SEPLAT Energy Plc*	7,75 %	01.04.2026	1.243.778	0,22
500.000	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**	4,75 %	15.02.2028	470.623	0,08
930.000	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**	4,75 %	01.04.2029	860.473	0,15
211.000	Shelf Drilling Holdings Ltd**	9,63 %	15.04.2029	206.634	0,04
740.000	Shriram Finance Ltd*	4,40 %	13.03.2024	735.501	0,13
800.000	SierraCol Energy Andina LLC**	6,00 %	15.06.2028	673.952	0,12
400.000	Sirius XM Radio Inc**	3,88 %	01.09.2031	342.693	0,06
1.760.000	Sirius XM Radio Inc**	4,00 %	15.07.2028	1.628.850	0,29
210.000	Sirius XM Radio Inc**	4,13 %	01.07.2030	187.402	0,03

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.005.000	Sirius XM Radio Inc**	5,50 %	01.07.2029	972.755	0,17
800.000	Sitio Royalties Operating Partnership LP/Sitio Finance Corp**	7,88 %	01.11.2028	829.648	0,15
410.000	Six Flags Entertainment Corp**	5,50 %	15.04.2027	401.138	0,07
805.000	Six Flags Entertainment Corp**	7,25 %	15.05.2031	808.003	0,14
910.000	SNF Group SACA**	3,13 %	15.03.2027	828.865	0,15
45.000	SNF Group SACA**	3,38 %	15.03.2030	38.711	0,01
2.885.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63 %	01.04.2026	2.927.418	0,52
2.130.000	SPX FLOW Inc**	8,75 %	01.04.2030	2.132.449	0,38
2.105.000	SRS Distribution Inc**	6,13 %	01.07.2029	1.998.140	0,36
790.000	Standard Industries Inc**	3,38 %	15.01.2031	680.791	0,12
285.000	Standard Industries Inc**	4,38 %	15.07.2030	262.081	0,05
990.000	Standard Industries Inc**	5,00 %	15.02.2027	965.945	0,17
745.000	Star Parent Inc**	9,00 %	01.10.2030	786.052	0,14
460.000	Starwood Property Trust Inc**	4,38 %	15.01.2027	434.003	0,08
660.000	Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp**	7,25 %	15.01.2031	695.857	0,12
2.030.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp**	9,00 %	15.10.2026	2.015.962	0,36
1.025.000	Sunnova Energy Corp**	5,88 %	01.09.2026	873.443	0,16
360.000	Sunnova Energy Corp**	11,75 %	01.10.2028	327.929	0,06
185.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50 %	15.01.2028	175.020	0,03
320.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	01.03.2027	313.245	0,06
1.875.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	31.12.2030	1.745.677	0,31
310.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	01.09.2031	287.173	0,05
620.000	Taylor Morrison Communities Inc**	5,13 %	01.08.2030	600.454	0,11
205.000	Taylor Morrison Communities Inc**	5,88 %	15.06.2027	206.260	0,04
910.000	Taylor Morrison Communities Inc**	6,63 %	15.07.2027	897.342	0,16
1.140.000	Team Health Holdings Inc†	13,50 %	30.06.2028	1.117.200	0,20
180.000	TEGNA Inc**	4,75 %	15.03.2026	175.221	0,03
210.000	Telecom Italia Capital SA**	6,00 %	30.09.2034	199.684	0,04
185.000	Telecom Italia Capital SA**	7,20 %	18.07.2036	185.952	0,03
616.000	Telecomunicaciones Digitales SA**	4,50 %	30.01.2030	531.547	0,10
360.000	Tenet Healthcare Corp**	4,25 %	01.06.2029	335.552	0,06
600.000	Tenet Healthcare Corp**	4,88 %	01.01.2026	593.662	0,11
1.670.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	01.10.2028	1.666.744	0,30
35.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	15.06.2030	35.432	0,01
985.000	Tenet Healthcare Corp**	6,25 %	01.02.2027	990.522	0,18
1.725.000	Tenet Healthcare Corp**	6,75 %	15.05.2031	1.765.193	0,32
1.515.000	TerraForm Power Operating LLC**	5,00 %	31.01.2028	1.472.904	0,26
700.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	4,10 %	01.10.2046	474.805	0,09
600.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	5,13 %	09.05.2029	573.673	0,10
1.455.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**	7,88 %	15.09.2029	1.569.961	0,28

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**	8,13 %	15.09.2031	327.549	0,06
375.000	TK Elevator Holdco GmbH**	7,63 %	15.07.2028	368.809	0,06
895.000	TK Elevator US Newco Inc**	5,25 %	15.07.2027	879.818	0,16
1.000.000	TMS International Corp**	6,25 %	15.04.2029	826.355	0,15
500.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV*	6,38 %	20.09.2028	203.765	0,04
1.180.000	TransDigm Inc*	4,63 %	15.01.2029	1.108.610	0,20
795.000	TransDigm Inc**	6,25 %	15.03.2026	794.433	0,14
1.385.000	TransDigm Inc**	6,75 %	15.08.2028	1.418.700	0,25
2.430.000	TransDigm Inc**	6,88 %	15.12.2030	2.504.492	0,45
580.000	TransDigm Inc*	7,50 %	15.03.2027	583.301	0,11
775.000	TreeHouse Foods Inc*	4,00 %	01.09.2028	686.998	0,12
40.000	Tri Pointe Homes Inc*	5,25 %	01.06.2027	39.346	0,01
935.000	Tri Pointe Homes Inc*	5,70 %	15.06.2028	926.122	0,17
965.000	Trident TPI Holdings Inc**	12,75 %	31.12.2028	1.033.756	0,19
1.005.000	Trivium Packaging Finance BV*	5,50 %	15.08.2026	987.065	0,18
1.390.000	Trivium Packaging Finance BV*	8,50 %	15.08.2027	1.364.464	0,24
616.000	Turk Telekomunikasyon AS*	4,88 %	19.06.2024	605.990	0,11
616.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*	5,80 %	11.04.2028	585.791	0,10
327.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	9,00 %	12.10.2028	343.723	0,06
95.000	United Airlines Inc**	4,38 %	15.04.2026	92.694	0,02
1.860.000	United Airlines Inc 144A**	4,38 %	15.04.2026	1.813.854	0,32
1.865.000	United Airlines Inc**	4,63 %	15.04.2029	1.746.163	0,31
690.000	United Rentals North America Inc*	3,75 %	15.01.2032	611.289	0,11
40.000	United Rentals North America Inc*	4,00 %	15.07.2030	36.888	0,01
380.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	4,75 %	15.04.2028	327.914	0,06
720.000	US Foods Inc**	4,75 %	15.02.2029	684.363	0,12
565.000	US Foods Inc**	6,88 %	15.09.2028	582.295	0,11
950.000	US Foods Inc**	7,25 %	15.01.2032	991.764	0,18
455.000	USI Inc**	7,50 %	15.01.2032	466.398	0,08
775.000	Valaris Ltd**	8,38 %	30.04.2030	794.681	0,14
950.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95 %	11.03.2025	707.313	0,13
550.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	486.079	0,09
1.700.000	Venture Global LNG Inc**	8,13 %	01.06.2028	1.718.372	0,31
1.210.000	Venture Global LNG Inc**	8,38 %	01.06.2031	1.211.195	0,22
860.000	Venture Global LNG Inc**	9,50 %	01.02.2029	910.561	0,16
550.000	Venture Global LNG Inc**	9,88 %	01.02.2032	573.245	0,10
1.000.000	Verde Purchaser LLC**	10,50 %	30.11.2030	1.008.900	0,18
1.240.000	Vibrantz Technologies Inc**	9,00 %	15.02.2030	984.834	0,18
605.000	Victoria's Secret & Co**	4,63 %	15.07.2029	506.125	0,09
1.310.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	5,50 %	15.05.2029	1.267.251	0,23

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 95,40 % (31. Dezember 2022: 81,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.665.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	6,38 %	01.02.2030	1.164.137	0,21
390.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	7,88 %	01.05.2027	335.890	0,06
335.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	9,50 %	01.06.2028	283.925	0,05
335.000	Vistra Operations Co LLC**	4,38 %	01.05.2029	313.097	0,06
355.000	Vistra Operations Co LLC**	5,63 %	15.02.2027	350.392	0,06
2.175.000	Vistra Operations Co LLC**	7,75 %	15.10.2031	2.260.562	0,41
1.960.000	VM Consolidated Inc**	5,50 %	15.04.2029	1.852.716	0,33
1.015.000	Vmed O2 UK Financing I Plc**	4,25 %	31.01.2031	887.597	0,16
301.000	VTR Finance NV**	6,38 %	15.07.2028	78.805	0,01
360.000	WE Soda Investments Holding Plc**	9,50 %	06.10.2028	372.528	0,07
1.290.000	White Cap Buyer LLC**	6,88 %	15.10.2028	1.250.348	0,22
1.530.000	White Cap Parent LLC**	8,25 %	15.03.2026	1.524.894	0,27
835.000	Williams Scotsman Inc**	7,38 %	01.10.2031	876.234	0,16
3.260.000	Windsor Holdings III LLC**	8,50 %	15.06.2030	3.410.866	0,61
865.000	WMG Acquisition Corp**	3,75 %	01.12.2029	788.599	0,14
355.000	WR Grace Holdings LLC**	5,63 %	15.08.2029	312.793	0,06
1.920.000	XHR LP**	4,88 %	01.06.2029	1.769.530	0,32
35.000	XPO Inc**	6,25 %	01.06.2028	35.486	0,01
1.045.000	XPO Inc**	7,13 %	01.06.2031	1.082.897	0,19
585.000	XPO Inc**	7,13 %	01.02.2032	604.134	0,11
300.000	Yanlord Land HK Co Ltd**	5,13 %	20.05.2026	174.837	0,03
800.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS*	5,85 %	21.06.2024	799.247	0,14
440.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS**	9,25 %	16.10.2028	467.194	0,09
500.000	YPF SA*	6,95 %	21.07.2027	447.886	0,08
500.000	YPF SA**	7,00 %	15.12.2047	378.228	0,07
500.000	YPF SA*	8,50 %	27.06.2029	463.548	0,08
735.000	Yum! Brands Inc*	3,63 %	15.03.2031	663.649	0,12
40.000	Yum! Brands Inc**	4,75 %	15.01.2030	38.816	0,01
245.000	Zayo Group Holdings Inc**	4,00 %	01.03.2027	196.685	0,04
355.000	ZF North America Capital Inc**	4,75 %	29.04.2025	351.200	0,06
315.000	ZF North America Capital Inc**	6,88 %	14.04.2028	326.622	0,06
535.000	ZF North America Capital Inc**	7,13 %	14.04.2030	570.823	0,10
185.000	Ziff Davis Inc**	4,63 %	15.10.2030	169.931	0,03
2.030.000	Ziggo BV*	4,88 %	15.01.2030	1.813.167	0,32
790.000	ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp**	3,88 %	01.02.2029	717.020	0,13
	US-Dollar insgesamt			**418.751.767**	**75,03**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**532.499.481**	**95,40**

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,31 %)				
	US-Dollar				
4.933	Starwood Property Mortgage LLC	8,71 %	26.07.2026	4.933	0,00
	Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †			**4.933**	**0,00**
	Anlagen insgesamt			**532.504.414**	**95,40**

Devisenterminkontrakte 2,14 % (31. Dezember 2022: 3,82 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
898.378 €	961.324 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	31.688	0,01
2.187.229 €	2.341.696 US$	18.01.2024	UBS AG	4	75.930	0,01
21.182.960 €	23.168.311 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	246.011	0,05
2.810.095 £	3.548.318 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	34.305	0,01
1.671.139 £	2.049.004 US$	18.01.2024	UBS AG	4	81.549	0,01
Abgesicherte Klassen AUD						
1.565 AUD	1.031 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	37	0,00
205 AUD	135 US$	18.01.2024	UBS AG	1	5	0,00
39.326 AUD	25.326 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	1.522	0,00
Abgesicherte Klassen CHF						
906.465 CHF	1.045.005 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	33.762	0,01
3.569.614 CHF	4.051.785 US$	18.01.2024	UBS AG	7	196.345	0,03
78.898.130 CHF	88.202.593 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	23	5.692.568	1,03
32.259 US$	26.940 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	199	0,00
Abgesicherte Klassen EUR						
1.030.137 €	1.110.288 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	28.361	0,00
58.382.707 €	62.244.767 US$	18.01.2024	UBS AG	5	2.287.832	0,41
59.186.586 €	63.087.794 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	27	2.333.363	0,41
45.569 US$	41.008 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	240	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
202.228 £	254.506 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	3.317	0,00
18.206.977 £	22.367.379 US$	18.01.2024	UBS AG	4	844.911	0,16
1.183.989 £	1.465.810 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	35	43.672	0,00
61.710 US$	48.358 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	57	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**11.935.674**	**2,14**

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**544.440.088**	**97,54**

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

(Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,21 %) (31. Dezember 2022: (2,80 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
90.430 €	100.000 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(44)	(0,00)
375.417 €	327.029 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(1.970)	(0,00)
935.858 €	819.679 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(10.579)	(0,00)
33.340 £	38.714 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(287)	(0,00)
1.840.618 £	2.348.408 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(1.782)	(0,00)
6.419.437 US$	5.867.308 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(65.918)	(0,02)
72.692 US$	57.866 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(1.082)	(0,00)
114.576.074 US$	107.621.530 €	18.01.2024	UBS AG	2	(4.382.047)	(0,79)
20.651.320 US$	16.819.926 £	18.01.2024	UBS AG	1	(792.602)	(0,14)
1.949.579 US$	1.597.060 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(86.532)	(0,02)
Abgesicherte Klassen AUD						
245 AUD	168 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
159 US$	251 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(12)	(0,00)
155 US$	244 AUD	18.01.2024	UBS AG	1	(12)	(0,00)
Abgesicherte Klassen CHF						
491.000 CHF	584.944 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(614)	(0,00)
543.078 US$	483.199 CHF	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(31.968)	(0,01)
529.683 US$	467.994 CHF	18.01.2024	UBS AG	1	(27.268)	(0,00)
3.497.645 US$	3.087.196 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	82	(176.371)	(0,02)
Abgesicherte Klassen EUR						
550.792 €	610.270 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(1.459)	(0,00)
46.251 €	51.406 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(283)	(0,00)
1.196.381 US$	1.128.477 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(50.966)	(0,02)
11.940.473 US$	11.203.653 €	18.01.2024	UBS AG	1	(443.346)	(0,08)
18.395.227 US$	17.196.600 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	83	(612.825)	(0,10)
Abgesicherte Klassen GBP						
92.070 £	117.768 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(387)	(0,00)
169 £	217 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(0)	(0,00)
284.770 US$	234.277 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(13.913)	(0,00)
1.448.163 US$	1.164.105 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	56	(35.967)	(0,01)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞]					**(6.738.234)**	**(1,21)**

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(6.738.234)**	**(1,21)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**537.701.854**	**96,33**
Sonstiges Nettovermögen	**20.462.051**	**3,67**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**558.163.905**	**100,00**

Global SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

	Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	142.684.669	25,23
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	388.697.612	68,72
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	1.122.133	0,20
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	5.197.440	0,92
Anlagen insgesamt		**537.701.854**	**95,07**

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %)				
	Kanadischer Dollar				
455.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada†	2,50 %	14.05.2030	308.382	0,36
195.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada†	4,45 %	27.02.2047	136.218	0,16
455.000	Canadian Pacific Railway Co†	2,54 %	28.02.2028	323.484	0,37
455.000	Enbridge Inc†	4,24 %	27.08.2042	301.745	0,35
410.000	TELUS Corp†	2,75 %	08.07.2026	299.375	0,34
325.000	TELUS Corp*	4,40 %	01.04.2043	221.589	0,26
620.000	Thomson Reuters Corp†	2,24 %	14.05.2025	454.579	0,52
	Kanadischer Dollar insgesamt			**2.045.372**	**2,36**
	Euro				
100.000	ABN AMRO Bank NV*	0,60 %	15.01.2027	102.005	0,12
200.000	ABN AMRO Bank NV*	5,50 %	21.09.2033	231.515	0,27
200.000	Allianz SE*	5,82 %	25.07.2053	242.568	0,28
139.000	American Tower Corp*	0,88 %	21.05.2029	134.061	0,15
150.000	American Tower Corp*	0,95 %	05.10.2030	139.291	0,16
200.000	American Tower Corp*	4,13 %	16.05.2027	225.846	0,26
250.000	Anheuser-Busch InBev SA*	2,75 %	17.03.2036	264.224	0,30
200.000	Arkema SA*	4,25 %	20.05.2030	231.094	0,27
200.000	Aroundtown SA*	1,00 %	07.01.2025	210.939	0,24
400.000	Aroundtown SA*	1,45 %	09.07.2028	345.680	0,40
300.000	Aroundtown SA*	1,63 %	31.01.2028	269.533	0,31
300.000	AT&T Inc*	2,45 %	15.03.2035	295.677	0,34
300.000	AT&T Inc*	4,30 %	18.11.2034	350.946	0,40
300.000	ATF Netherlands BV*	7,08 %	29.12.2049	145.907	0,17
190.000	Athene Global Funding*	0,83 %	08.01.2027	193.779	0,22
157.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd*	1,63 %	11.03.2081	156.960	0,18
100.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd*	5,10 %	03.02.2033	113.704	0,13
100.000	Banco Santander SA*	4,88 %	18.10.2031	117.776	0,14
150.000	Bank of America Corp*	1,95 %	27.10.2026	160.924	0,18
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	3,88 %	16.06.2032	109.299	0,13
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	4,38 %	02.05.2030	114.969	0,13
100.000	Barclays Plc*	4,92 %	08.08.2030	115.183	0,13
500.000	Bayerische Landesbank*	7,00 %	05.01.2034	573.149	0,66
100.000	BP Capital Markets Plc*	1,10 %	15.11.2034	87.459	0,10
100.000	BPCE SA*	4,75 %	14.06.2034	117.770	0,13
100.000	BPCE SA*	5,13 %	25.01.2035	113.890	0,13
100.000	BPCE SA*	5,75 %	01.06.2033	116.933	0,13
100.000	BUPA Finance Plc*	5,00 %	12.10.2030	118.891	0,14
300.000	Carmila SA*	5,50 %	09.10.2028	343.990	0,40
100.000	Commerzbank AG*	5,13 %	18.01.2030	115.809	0,13

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
100.000	Commerzbank AG*	6,75 %	05.10.2033	117.861	0,14
136.000	Digital Dutch Finco BV*	1,00 %	15.01.2032	119.932	0,14
310.000	Digital Dutch Finco BV*	1,25 %	01.02.2031	287.094	0,33
322.000	Discovery Communications LLC*	1,90 %	19.03.2027	339.094	0,39
100.000	Duke Energy Corp*	3,85 %	15.06.2034	109.537	0,13
100.000	Electricite de France SA*	4,75 %	12.10.2034	119.410	0,14
100.000	Enel SpA*	6,63 %	29.12.2049	117.799	0,14
200.000	Fastighets AB Balder*	1,88 %	23.01.2026	201.802	0,23
269.000	Global Payments Inc*	4,88 %	17.03.2031	312.709	0,36
120.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	0,63 %	24.07.2025	117.831	0,14
400.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	1,00 %	13.04.2028	318.237	0,37
117.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	1,38 %	03.03.2027	102.753	0,12
740.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	1,38 %	24.07.2028	589.046	0,68
410.000	HSBC Holdings Plc*	4,79 %	10.03.2032	479.820	0,55
200.000	Imerys SA*	4,75 %	29.11.2029	224.722	0,26
100.000	ING Groep NV*	4,75 %	23.05.2034	117.770	0,14
150.000	Intesa Sanpaolo SpA**	5,63 %	08.03.2033	178.659	0,21
400.000	JPMorgan Chase & Co*	4,46 %	13.11.2031	466.164	0,54
100.000	Linde Plc*	3,63 %	12.06.2034	115.899	0,13
200.000	McDonald's Corp*	4,13 %	28.11.2035	233.469	0,27
95.000	Metropolitan Life Global Funding I*	4,00 %	05.04.2028	108.369	0,12
165.000	Morgan Stanley*	5,15 %	25.01.2034	200.719	0,23
73.000	Nasdaq Inc*	0,90 %	30.07.2033	64.076	0,07
160.000	National Grid North America Inc*	4,67 %	12.09.2033	188.934	0,22
186.000	National Grid Plc*	2,95 %	30.03.2030	200.466	0,23
483.000	Nationwide Building Society*	2,00 %	25.07.2029	523.616	0,60
130.000	Nationwide Building Society*	4,50 %	01.11.2026	148.156	0,17
249.000	NatWest Group Plc*	0,67 %	14.09.2029	239.407	0,28
121.000	NatWest Group Plc*	1,04 %	14.09.2032	118.288	0,14
125.000	Nordea Bank Abp*	1,00 %	27.06.2029	135.245	0,16
100.000	Orsted AS*	5,25 %	29.12.2049	110.355	0,13
175.000	Procter & Gamble Co*	3,25 %	02.08.2031	199.768	0,23
200.000	Sandoz Finance BV*	4,50 %	17.11.2033	234.760	0,27
200.000	Sogecap SA*	6,50 %	16.05.2044	238.995	0,27
831.000	Southern Co*	1,88 %	15.09.2081	789.532	0,91
155.000	Svenska Handelsbanken AB*	5,00 %	16.08.2034	179.842	0,21
500.000	Thames Water Utilities Finance Plc*	4,38 %	18.01.2031	523.913	0,60
124.000	TotalEnergies SE*	1,63 %	29.12.2049	122.878	0,14
200.000	Traton Finance Luxembourg SA*	4,50 %	23.11.2026	225.751	0,26
600.000	UBS Group AG*	3,25 %	02.04.2026	657.056	0,76

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
365.000	UBS Group AG*	4,38 %	11.01.2031	416.890	0,48
200.000	UBS Group AG*	4,75 %	17.03.2032	233.232	0,27
392.000	Verizon Communications Inc*	0,75 %	22.03.2032	356.057	0,41
116.000	Verizon Communications Inc*	4,25 %	31.10.2030	136.021	0,16
100.000	Volkswagen Bank GmbH*	4,63 %	03.05.2031	116.027	0,13
100.000	Volkswagen International Finance NV*	4,25 %	29.03.2029	114.917	0,13
	Euro insgesamt			**17.112.649**	**19,72**
	Britisches Pfund				
150.000	Admiral Group Plc*	8,50 %	06.01.2034	210.462	0,24
225.000	Barclays Plc*	7,09 %	06.11.2029	305.794	0,35
152.000	Barclays Plc*	8,41 %	14.11.2032	206.909	0,24
539.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl**	2,63 %	20.10.2028	587.440	0,68
100.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl*	4,88 %	29.04.2032	113.428	0,13
200.000	British Telecommunications Plc*	5,75 %	13.02.2041	263.582	0,30
200.000	Coventry Building Society*	7,00 %	07.11.2027	265.679	0,31
90.000	Danske Bank A/S*	2,25 %	14.01.2028	104.857	0,12
100.000	Electricite de France SA*	6,00 %	29.12.2049	124.432	0,14
214.000	GE Capital UK Funding Unlimited Co*	8,00 %	14.01.2039	339.541	0,39
130.000	Holcim Sterling Finance Netherlands BV*	2,25 %	04.04.2034	128.326	0,15
200.000	Intesa Sanpaolo SpA*	5,15 %	10.06.2030	231.274	0,27
100.000	Intesa Sanpaolo SpA**	6,63 %	31.05.2033	134.879	0,16
100.000	Logicor Financing Sarl*	2,75 %	15.01.2030	105.160	0,12
100.000	National Grid Electricity Distribution South West Plc*	5,82 %	31.07.2041	136.597	0,16
115.000	NatWest Group Plc*	7,42 %	06.06.2033	153.325	0,18
103.000	Orsted A/S*	5,13 %	13.09.2034	130.967	0,15
240.000	OSB Group Plc*	9,50 %	07.09.2028	315.151	0,36
300.000	Pension Insurance Corp Plc*	8,00 %	13.11.2033	410.434	0,47
165.000	Phoenix Group Holdings Plc*	5,63 %	28.04.2031	199.416	0,23
200.000	Phoenix Group Holdings Plc*	7,75 %	06.12.2053	267.000	0,31
100.000	Principality Building Society*	8,63 %	12.07.2028	138.056	0,16
200.000	RAC Bond Co Plc*	8,25 %	06.11.2028	274.881	0,32
200.000	Rothesay Life Plc*	7,73 %	16.05.2033	272.271	0,31
113.000	Santander UK Group Holdings Plc*	7,10 %	16.11.2027	149.903	0,17
100.000	SW Finance I Plc*	7,38 %	12.12.2041	136.882	0,16
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc*	8,25 %	25.04.2040	143.360	0,16
120.000	Virgin Money UK Plc*	5,13 %	11.12.2030	146.851	0,17
215.000	Virgin Money UK Plc*	7,63 %	23.08.2029	291.719	0,34
100.000	Volkswagen Financial Services NV*	6,50 %	18.09.2027	133.353	0,15
	Britisches Pfund insgesamt			**6.421.929**	**7,40**

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar				
525.000	AbbVie Inc*	4,05 %	21.11.2039	474.332	0,55
500.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	1,75 %	30.01.2026	464.608	0,54
235.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	3,00 %	29.10.2028	214.667	0,25
180.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	3,40 %	29.10.2033	154.673	0,18
230.000	Air Lease Corp*	3,38 %	01.07.2025	222.733	0,26
305.000	Air Lease Corp*	4,63 %	01.10.2028	298.380	0,34
246.058	American Airlines 2021-1 Class A Pass Through Trust**	2,88 %	11.07.2034	209.295	0,24
180.000	American Express Co**	6,49 %	30.10.2031	195.306	0,23
400.000	Amgen Inc**	2,80 %	15.08.2041	291.154	0,34
110.000	Amgen Inc**	4,20 %	22.02.2052	93.233	0,11
250.000	Amgen Inc**	4,40 %	01.05.2045	222.214	0,26
615.000	Amgen Inc**	5,15 %	02.03.2028	629.860	0,73
695.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc*	5,45 %	23.01.2039	733.480	0,85
360.000	Appalachian Power Co**	3,70 %	01.05.2050	270.111	0,31
255.000	Apple Inc**	2,38 %	08.02.2041	186.563	0,22
500.000	Apple Inc**	3,45 %	09.02.2045	416.939	0,48
315.000	AT&T Inc*	3,50 %	01.06.2041	250.353	0,29
400.000	AT&T Inc*	4,35 %	01.03.2029	394.968	0,46
1.000.000	Athene Global Funding**	1,61 %	29.06.2026	905.681	1,04
215.000	Baltimore Gas & Electric Co**	4,55 %	01.06.2052	197.359	0,23
685.000	Bank of America Corp**	1,90 %	23.07.2031	560.729	0,65
415.000	Bank of America Corp**	2,59 %	29.04.2031	357.875	0,41
400.000	Barclays Plc*	2,85 %	07.05.2026	385.827	0,44
200.000	Barclays Plc*	2,89 %	24.11.2032	164.029	0,19
275.000	Barclays Plc*	4,97 %	16.05.2029	270.223	0,31
125.000	Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada*	5,10 %	11.05.2033	128.337	0,15
500.000	BNP Paribas SA**	2,22 %	09.06.2026	477.561	0,55
275.000	BNP Paribas SA**	4,25 %	15.10.2024	271.990	0,31
185.000	Boeing Co*	3,63 %	01.02.2031	171.916	0,20
260.000	Boeing Co*	5,71 %	01.05.2040	269.091	0,31
205.000	Boeing Co*	5,81 %	01.05.2050	212.432	0,24
160.000	Boeing Co*	5,93 %	01.05.2060	165.965	0,19
200.000	Bristol-Myers Squibb Co**	4,35 %	15.11.2047	176.541	0,20
190.000	Bristol-Myers Squibb Co*	6,40 %	15.11.2063	220.349	0,25
335.000	Capital One Financial Corp*	4,20 %	29.10.2025	328.712	0,38
125.000	Carrier Global Corp**	5,90 %	15.03.2034	135.571	0,16
450.000	CDW LLC/CDW Finance Corp**	3,57 %	01.12.2031	399.686	0,46
460.000	Centene Corp*	2,45 %	15.07.2028	410.023	0,47
460.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	2,25 %	15.01.2029	399.391	0,46
185.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	2,80 %	01.04.2031	156.173	0,18

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
330.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80 %	01.03.2050	255.867	0,29
185.000	Cigna Group*	4,90 %	15.12.2048	176.094	0,20
285.000	Citibank NA**	5,80 %	29.09.2028	297.761	0,34
435.000	Citigroup Inc**	3,89 %	10.01.2028	420.884	0,49
275.000	Citigroup Inc**	4,41 %	31.03.2031	263.252	0,30
210.000	Citigroup Inc**	6,17 %	25.05.2034	217.384	0,25
120.000	CNH Industrial Capital LLC*	5,45 %	14.10.2025	120.589	0,14
200.000	Comcast Corp**	3,40 %	15.07.2046	155.125	0,18
380.000	Comcast Corp**	3,75 %	01.04.2040	327.083	0,38
480.000	Comcast Corp**	4,80 %	15.05.2033	486.202	0,56
250.000	Constellation Brands Inc*	3,15 %	01.08.2029	232.540	0,27
520.000	Constellation Brands Inc*	4,75 %	09.05.2032	518.363	0,60
535.000	Cooperatieve Rabobank UA**	5,50 %	18.07.2025	540.958	0,62
235.000	Corebridge Financial Inc*	5,75 %	15.01.2034	240.386	0,28
540.000	Cox Communications Inc**	5,70 %	15.06.2033	562.948	0,65
500.000	CVS Health Corp*	2,70 %	21.08.2040	356.765	0,41
225.000	CVS Health Corp*	5,05 %	25.03.2048	210.639	0,24
445.000	CVS Health Corp*	5,13 %	21.02.2030	452.167	0,52
700.000	Dell International LLC/EMC Corp**	5,30 %	01.10.2029	721.393	0,83
452.000	Dominion Energy Inc*	3,07 %	15.08.2024	444.695	0,51
520.000	Dominion Energy Inc*	5,38 %	15.11.2032	534.351	0,62
405.000	DTE Energy Co**	2,53 %	01.10.2024	395.708	0,46
250.000	Emerson Electric Co*	2,80 %	21.12.2051	172.007	0,20
370.000	Enbridge Inc*	5,70 %	08.03.2033	384.733	0,44
335.000	Energy Transfer LP*	6,55 %	01.12.2033	364.026	0,42
200.000	Entergy Corp*	3,75 %	15.06.2050	151.270	0,17
190.000	Equitable Holdings Inc**	5,00 %	20.04.2048	176.784	0,20
300.000	Exelon Corp**	4,45 %	15.04.2046	262.098	0,30
640.000	F&G Global Funding**	5,15 %	07.07.2025	631.025	0,73
400.000	Ford Motor Credit Co LLC*	6,80 %	07.11.2028	418.796	0,48
165.000	Fox Corp**	6,50 %	13.10.2033	178.707	0,21
640.000	GE HealthCare Technologies Inc**	5,60 %	15.11.2025	645.880	0,74
190.000	General Motors Financial Co Inc*	3,60 %	21.06.2030	172.532	0,20
200.000	General Motors Financial Co Inc*	5,80 %	23.06.2028	205.664	0,24
100.000	Gilead Sciences Inc**	5,25 %	15.10.2033	104.275	0,12
115.000	Gilead Sciences Inc**	5,55 %	15.10.2053	124.707	0,14
470.000	Goldman Sachs Group Inc**	1,54 %	10.09.2027	426.486	0,49
900.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,81 %	23.04.2029	854.979	0,99
400.000	Home Depot Inc*	4,25 %	01.04.2046	361.894	0,42
1.125.000	HSBC Holdings Plc*	2,01 %	22.09.2028	1.002.020	1,15

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
195.000	Humana Inc**	5,50 %	15.03.2053	202.648	0,23
410.000	Intel Corp**	4,88 %	10.02.2028	417.079	0,48
185.000	Intel Corp**	4,90 %	05.08.2052	181.241	0,21
120.000	Intel Corp**	5,70 %	10.02.2053	129.858	0,15
160.000	International Business Machines Corp*	4,00 %	20.06.2042	139.459	0,16
285.000	Intesa Sanpaolo SpA**	7,78 %	20.06.2054	296.555	0,34
200.000	Intesa Sanpaolo SpA**	8,25 %	21.11.2033	217.194	0,25
585.000	ITC Holdings Corp**	2,95 %	14.05.2030	515.549	0,59
205.000	John Deere Capital Corp*	4,95 %	14.07.2028	210.296	0,24
415.000	JPMorgan Chase & Co**	0,97 %	23.06.2025	405.373	0,47
230.000	JPMorgan Chase & Co**	1,47 %	22.09.2027	208.475	0,24
500.000	JPMorgan Chase & Co**	2,30 %	15.10.2025	487.308	0,56
900.000	JPMorgan Chase & Co**	4,01 %	23.04.2029	866.653	1,00
155.000	JPMorgan Chase & Co**	6,25 %	23.10.2034	168.108	0,19
410.000	Kenvue Inc**	5,00 %	22.03.2030	423.529	0,49
145.000	Kinder Morgan Inc*	5,55 %	01.06.2045	139.745	0,16
280.000	KLA Corp**	4,95 %	15.07.2052	283.186	0,33
250.000	L3Harris Technologies Inc*	5,40 %	15.01.2027	255.310	0,29
250.000	L3Harris Technologies Inc*	5,40 %	31.07.2033	260.051	0,30
520.000	Lloyds Banking Group Plc*	3,87 %	09.07.2025	515.190	0,59
230.000	Lloyds Banking Group Plc*	7,95 %	15.11.2033	263.137	0,30
275.000	Lowe's Cos Inc*	3,00 %	15.10.2050	187.300	0,22
230.000	Lowe's Cos Inc*	3,75 %	01.04.2032	215.364	0,25
400.000	Marathon Petroleum Corp**	4,70 %	01.05.2025	397.619	0,46
315.000	Mars Inc**	4,55 %	20.04.2028	316.897	0,37
325.000	Marvell Technology Inc**	5,75 %	15.02.2029	336.015	0,39
125.000	Marvell Technology Inc**	5,95 %	15.09.2033	132.647	0,15
285.000	McDonald's Corp*	3,63 %	01.09.2049	228.715	0,26
400.000	Mercedes-Benz Finance North America LLC**	5,25 %	29.11.2027	408.995	0,47
85.000	Merck & Co Inc*	2,90 %	10.12.2061	56.869	0,07
305.000	Meta Platforms Inc**	5,60 %	15.05.2053	330.814	0,38
330.000	Mohawk Industries Inc*	5,85 %	18.09.2028	342.382	0,39
370.000	Molson Coors Beverage Co*	3,00 %	15.07.2026	354.577	0,41
240.000	Morgan Stanley**	1,93 %	28.04.2032	193.090	0,22
500.000	Morgan Stanley**	2,70 %	22.01.2031	437.403	0,50
405.000	Morgan Stanley**	5,12 %	01.02.2029	407.070	0,47
375.000	Mosaic Co*	5,38 %	15.11.2028	383.048	0,44
265.000	MPLX LP*	5,00 %	01.03.2033	259.734	0,30
605.000	Nationwide Building Society*	6,56 %	18.10.2027	626.651	0,72
410.000	NatWest Group Plc*	5,81 %	13.09.2029	420.780	0,49

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
310.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc*	5,25 %	28.02.2053	305.115	0,35
300.000	NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc**	4,30 %	18.06.2029	291.678	0,34
150.000	NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc**	5,00 %	15.01.2033	150.331	0,17
285.000	Occidental Petroleum Corp*	6,13 %	01.01.2031	296.231	0,34
380.000	Occidental Petroleum Corp**	6,45 %	15.09.2036	402.569	0,46
500.000	Oracle Corp*	2,88 %	25.03.2031	443.161	0,51
200.000	Oracle Corp*	4,00 %	15.07.2046	160.664	0,19
260.000	Oracle Corp*	4,90 %	06.02.2033	258.960	0,30
440.000	Oracle Corp*	6,15 %	09.11.2029	473.663	0,55
205.000	PACCAR Financial Corp**	4,95 %	10.08.2028	211.615	0,24
190.000	Pacific Gas & Electric Co*	6,95 %	15.03.2034	208.946	0,24
390.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd*	5,11 %	19.05.2043	388.849	0,45
295.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd*	5,34 %	19.05.2063	298.076	0,34
185.000	Phillips 66*	3,30 %	15.03.2052	132.678	0,15
130.000	PNC Financial Services Group Inc**	6,62 %	20.10.2027	134.907	0,16
155.000	PNC Financial Services Group Inc**	6,88 %	20.10.2034	172.137	0,20
285.000	Public Service Enterprise Group Inc*	6,13 %	15.10.2033	306.576	0,35
260.000	QUALCOMM Inc**	6,00 %	20.05.2053	299.451	0,35
220.000	Quest Diagnostics Inc*	6,40 %	30.11.2033	244.090	0,28
575.000	Rogers Communications Inc**	4,50 %	15.03.2042	507.884	0,59
355.000	Rogers Communications Inc*	5,00 %	15.03.2044	334.171	0,39
225.000	RTX Corp*	4,63 %	16.11.2048	205.667	0,24
155.000	RTX Corp*	6,40 %	15.03.2054	179.569	0,21
500.000	Societe Generale SA**	3,63 %	01.03.2041	341.549	0,39
155.000	Southern California Edison Co*	4,88 %	01.03.2049	142.503	0,16
320.000	Southern Co*	4,85 %	15.06.2028	322.611	0,37
315.000	Sprint Capital Corp**	8,75 %	15.03.2032	389.163	0,45
250.000	Synchrony Bank*	5,40 %	22.08.2025	246.387	0,28
370.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd**	3,03 %	09.07.2040	284.598	0,33
500.000	T-Mobile USA Inc**	3,75 %	15.04.2027	485.114	0,56
140.000	T-Mobile USA Inc**	4,50 %	15.04.2050	123.828	0,14
235.000	T-Mobile USA Inc**	5,80 %	15.09.2062	252.294	0,29
145.000	Truist Financial Corp**	5,87 %	08.06.2034	148.015	0,17
200.000	Tucson Electric Power Co*	3,25 %	01.05.2051	138.127	0,16
380.000	Union Pacific Corp*	3,20 %	20.05.2041	304.579	0,35
1.164.570	United Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust**	5,88 %	15.10.2027	1.180.402	1,36
383.000	United Airlines 2023-1 Class A Pass Through Trust**	5,80 %	15.01.2036	389.897	0,45
255.000	UnitedHealth Group Inc*	5,20 %	15.04.2063	260.591	0,30
155.000	UnitedHealth Group Inc*	6,05 %	15.02.2063	179.013	0,21
450.000	Verizon Communications Inc*	2,85 %	03.09.2041	332.785	0,38

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 93,78 % (31. Dezember 2022: 94,02 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
400.000	Vodafone Group Plc**	4,38 %	19.02.2043	349.152	0,40
185.000	Vodafone Group Plc**	4,88 %	19.06.2049	167.895	0,19
260.000	Walmart Inc*	4,50 %	15.04.2053	252.926	0,29
285.000	Walt Disney Co*	3,60 %	13.01.2051	229.286	0,26
225.000	Warnermedia Holdings Inc**	3,76 %	15.03.2027	215.672	0,25
205.000	Warnermedia Holdings Inc**	5,05 %	15.03.2042	180.826	0,21
250.000	Waste Management Inc*	4,88 %	15.02.2029	256.000	0,30
250.000	Waste Management Inc*	4,88 %	15.02.2034	255.146	0,29
1.090.000	WEC Energy Group Inc*	4,75 %	09.01.2026	1.086.194	1,25
305.000	Wells Fargo & Co**	5,57 %	25.07.2029	311.607	0,36
455.000	Wells Fargo & Co**	6,30 %	23.10.2029	479.816	0,55
80.000	Westlake Corp*	3,38 %	15.08.2061	51.618	0,06
365.000	Zimmer Biomet Holdings Inc*	3,05 %	15.01.2026	352.508	0,41
	US-Dollar insgesamt			**55.796.371**	**64,30**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**81.376.321**	**93,78**
	Staatsanleihen 2,40 % (31. Dezember 2022: 3,21 %)				
	Euro				
530.000	European Union	0,80 %	04.07.2025	568.053	0,65
175.000	European Union	2,00 %	04.10.2027	190.483	0,22
	Euro insgesamt			**758.536**	**0,87**
	US-Dollar				
250.000	United States Treasury Note/Bond	4,13 %	15.08.2053	252.774	0,29
635.000	United States Treasury Note/Bond	4,38 %	15.12.2026	641.300	0,74
420.000	United States Treasury Note/Bond	4,38 %	30.11.2028	429.844	0,50
	US-Dollar insgesamt			**1.323.918**	**1,53**
	Staatsanleihen insgesamt *			**2.082.454**	**2,40**
	Anlagen insgesamt			**83.458.775**	**96,18**

Devisenterminkontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,01 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
27.800 €	29.627 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	4	1.101	0,00
1.047 €	1.143 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	14	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**1.115**	**0,00**

Global Investment Grade Credit - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**83.459.890**	**96,18**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,28 %) (31. Dezember 2022: (1,91 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
5.341 US$	5.000 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(186)	(0,00)
432.310 US$	395.834 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(5.220)	(0,01)
6.987.605 US$	5.723.090 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(308.829)	(0,36)
1.940.938 US$	2.640.019 CAD	18.01.2024	UBS AG	1	(61.656)	(0,07)
1.112 US$	1.050 €	18.01.2024	UBS AG	1	(49)	(0,00)
359.825 US$	283.497 £	18.01.2024	UBS AG	1	(1.609)	(0,00)
17.008.463 US$	16.047.911 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(729.896)	(0,84)
Abgesicherte Klassen EUR						
181 €	201 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
165 US$	153 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(5)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(1.107.450)**	**(1,28)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(1.107.450)**	**(1,28)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**82.352.440**	**94,90**
Sonstiges Nettovermögen	**4.425.385**	**5,10**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**86.777.825**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	50.897.570	57,87
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	30.737.422	34,95
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	1.823.783	2,07
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(1.106.335)	(1,26)
Anlagen insgesamt		**82.352.440**	**93,63**

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 2,78 % (31. Dezember 2022: 5,64 %)				
	Euro				
76.813	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	6,88 %	24.02.2058	84.280	0,13
161.283	FTA Santander Consumo 4 Class C	2,20 %	18.09.2032	169.848	0,26
118.199	Futura S.r.l. 2019-1 Class A	6,97 %	31.07.2044	130.107	0,20
	Euro insgesamt			**384.235**	**0,59**
	Britisches Pfund				
53.220	Towd Point Mortgage Funding 2018 - Auburn 12 Plc Class A	6,69 %	20.02.2045	67.935	0,10
	Britisches Pfund insgesamt			**67.935**	**0,10**
	US-Dollar				
183.840	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	8,10 %	25.02.2030	189.062	0,29
132.535	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	7,65 %	25.08.2030	134.544	0,20
445.617	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	7,25 %	25.07.2030	448.678	0,69
147.123	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	7,80 %	25.04.2030	150.100	0,23
428.781	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	8,70 %	25.07.2029	443.189	0,68
	US-Dollar insgesamt			**1.365.573**	**2,09**
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **			**1.817.743**	**2,78**
	Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %)				
	Euro				
100.000	888 Acquisitions Ltd**	7,56 %	15.07.2027	105.742	0,16
100.000	Abertis Infraestructuras Finance BV*	3,25 %	29.12.2049	106.312	0,16
100.000	Adevinta ASA*	3,00 %	15.11.2027	110.184	0,17
150.000	Allwyn International AS**	3,88 %	15.02.2027	159.898	0,24
100.000	Altice Financing SA**	4,25 %	15.08.2029	98.335	0,15
147.000	Altice France Holding SA*	4,00 %	15.02.2028	72.398	0,11
100.000	Altice France SA**	4,13 %	15.01.2029	88.599	0,14
100.000	American Tower Corp*	0,88 %	21.05.2029	96.447	0,15
150.000	Anheuser-Busch InBev SA*	2,00 %	23.01.2035	148.937	0,23
130.000	Anheuser-Busch InBev SA*	2,75 %	17.03.2036	137.397	0,21
120.000	Apple Inc*	0,50 %	15.11.2031	113.276	0,17
100.000	Aramark International Finance Sarl*	3,13 %	01.04.2025	110.220	0,17
150.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc*	3,00 %	01.09.2029	134.069	0,20
139.000	Ashland Services BV**	2,00 %	30.01.2028	143.047	0,22
100.000	Assemblin Group AB**	8,96 %	05.07.2029	112.373	0,17
100.000	Avantor Funding Inc*	3,88 %	15.07.2028	108.504	0,17
100.000	Avis Budget Finance Plc**	7,25 %	31.07.2030	118.589	0,18
100.000	Banco Santander SA*	4,88 %	18.10.2031	117.776	0,18

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
103.000	Banijay Entertainment SASU**	7,00 %	01.05.2029	120.307	0,18
107.000	Banijay Group SAS**	6,50 %	01.03.2026	118.365	0,18
300.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	1,25 %	03.06.2030	287.201	0,44
270.000	Barclays Plc*	0,58 %	09.08.2029	257.015	0,39
100.000	Bayer AG*	2,38 %	12.11.2079	106.232	0,16
100.000	Bayer AG*	5,38 %	25.03.2082	105.272	0,16
100.000	Bayerische Landesbank*	7,00 %	05.01.2034	114.630	0,18
178.000	BCP V Modular Services Finance Plc**	6,75 %	30.11.2029	162.048	0,25
100.000	Benteler International AG*	9,38 %	15.05.2028	118.283	0,18
100.000	Birkenstock Financing Sarl*	5,25 %	30.04.2029	110.171	0,17
100.000	Boels Topholding BV**	6,25 %	15.02.2029	115.717	0,18
171.000	Booking Holdings Inc*	0,50 %	08.03.2028	171.492	0,26
100.000	BUPA Finance Plc*	5,00 %	12.10.2030	118.891	0,18
100.000	Carmila SA*	5,50 %	09.10.2028	114.663	0,18
100.000	CECONOMY AG*	1,75 %	24.06.2026	96.267	0,15
100.000	Cellnex Finance Co SA*	1,50 %	08.06.2028	101.404	0,15
150.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH**	4,38 %	15.01.2028	161.932	0,25
100.000	Cirsa Finance International Sarl*	7,88 %	31.07.2028	115.543	0,18
100.000	Constellium SE*	4,25 %	15.02.2026	110.187	0,17
100.000	Coty Inc**	3,88 %	15.04.2026	110.496	0,17
100.000	CPI Property Group SA*	1,75 %	14.01.2030	63.146	0,10
100.000	Ctec II GmbH**	5,25 %	15.02.2030	99.255	0,15
100.000	Dana Financing Luxembourg Sarl*	8,50 %	15.07.2031	121.180	0,19
100.000	Deutsche Lufthansa AG*	3,00 %	29.05.2026	107.760	0,16
100.000	Deutsche Lufthansa AG*	3,75 %	11.02.2028	109.230	0,17
200.000	Digital Intrepid Holding BV*	0,63 %	15.07.2031	173.715	0,27
100.000	Douglas GmbH*	6,00 %	08.04.2026	109.463	0,17
200.000	EDP - Energias de Portugal SA*	5,94 %	23.04.2083	229.884	0,35
400.000	Electricite de France SA*	7,50 %	29.12.2049	483.505	0,74
150.000	Emerald Debt Merger Sub LLC†	6,38 %	15.12.2030	177.636	0,27
270.000	EnBW International Finance BV*	0,13 %	01.03.2028	269.208	0,41
100.000	Enel SpA*	6,38 %	29.12.2049	115.760	0,18
127.000	Energia Group Roi Financeco DAC**	6,88 %	31.07.2028	145.983	0,22
100.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50 %	30.06.2029	95.548	0,15
100.000	Ephios Subco 3 Sarl**	7,88 %	31.01.2031	114.517	0,18
100.000	Eroski S Coop*	10,63 %	30.04.2029	114.089	0,17
100.000	Fastighets AB Balder*	2,87 %	02.06.2081	83.656	0,13
100.000	Fiber Bidco SpA*	11,00 %	25.10.2027	120.882	0,18
100.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,87 %	03.08.2027	113.667	0,17

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
100.000	Fiserv Inc*	1,63 %	01.07.2030	100.065	0,15
100.000	Forvia SE*	2,38 %	15.06.2027	104.740	0,16
100.000	Grifols SA*	1,63 %	15.02.2025	108.393	0,17
100.000	Gruenenthal GmbH**	4,13 %	15.05.2028	109.588	0,17
100.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,50 %	30.04.2028	84.322	0,13
100.000	Guala Closures SpA*	3,25 %	15.06.2028	104.209	0,16
235.000	Haleon Netherlands Capital BV*	1,75 %	29.03.2030	239.777	0,37
150.000	Heimstaden Bostad AB*	3,25 %	29.12.2049	87.056	0,13
100.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	1,38 %	24.07.2028	79.601	0,12
200.000	IHO Verwaltungs GmbH*	3,88 %	15.05.2027	216.944	0,33
100.000	Iliad Holding SASU**	5,13 %	15.10.2026	110.393	0,17
100.000	iliad SA*	5,38 %	14.06.2027	113.710	0,17
100.000	Imerys SA*	4,75 %	29.11.2029	112.361	0,17
200.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc*	3,75 %	15.07.2026	213.873	0,33
100.000	International Consolidated Airlines Group SA*	3,75 %	25.03.2029	107.086	0,16
100.000	Intrum AB*	3,00 %	15.09.2027	84.477	0,13
100.000	IPD 3 BV*	8,00 %	15.06.2028	118.206	0,18
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50 %	15.07.2028	108.159	0,17
200.000	JPMorgan Chase & Co*	4,46 %	13.11.2031	233.082	0,36
100.000	Kapla Holding SAS*	3,38 %	15.12.2026	107.204	0,16
100.000	Koninklijke KPN NV*	6,00 %	29.12.2049	114.730	0,18
59.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,00 %	15.06.2026	61.383	0,09
21.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,00 %	15.09.2031	19.222	0,03
27.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,01 %	05.05.2027	27.561	0,04
18.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau**	0,38 %	09.03.2026	19.003	0,03
47.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau**	0,75 %	28.06.2028	48.302	0,07
32.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	0,75 %	15.01.2029	32.572	0,05
46.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau*	1,25 %	30.06.2027	48.865	0,07
100.000	LHMC Finco 2 Sarl*	7,25 %	02.10.2025	110.065	0,17
200.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	216.235	0,33
100.000	Lottomatica SpA**	7,13 %	01.06.2028	116.710	0,18
100.000	Loxam SAS*	5,75 %	15.07.2027	109.040	0,17
100.000	McDonald's Corp*	4,13 %	28.11.2035	116.734	0,18
100.000	Medtronic Global Holdings SCA*	1,38 %	15.10.2040	81.322	0,12
150.000	Molson Coors Beverage Co*	1,25 %	15.07.2024	163.256	0,25
100.000	Mooney Group SpA**	7,81 %	17.12.2026	108.920	0,17
100.000	Morgan Stanley*	0,50 %	26.10.2029	95.474	0,15
100.000	Motion Finco Sarl**	7,38 %	15.06.2030	113.192	0,17
100.000	Multiversity SRL*	8,20 %	30.10.2028	111.155	0,17
100.000	National Grid North America Inc*	4,67 %	12.09.2033	118.084	0,18

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
150.000	Nidda Healthcare Holding GmbH**	7,50 %	21.08.2026	171.131	0,26
100.000	Olympus Water US Holding Corp*	3,88 %	01.10.2028	101.545	0,16
100.000	PCF GmbH*	4,75 %	15.04.2026	81.027	0,12
100.000	PEU Finance Plc*	7,25 %	01.07.2028	113.946	0,17
100.000	Piaggio & C SpA*	6,50 %	05.10.2030	116.844	0,18
100.000	PrestigeBidCo GmbH**	9,97 %	15.07.2027	112.444	0,17
100.000	Q-Park Holding I BV**	1,50 %	01.03.2025	108.471	0,17
100.000	RCS & RDS SA*	2,50 %	05.02.2025	108.313	0,17
100.000	Sandoz Finance BV*	4,50 %	17.11.2033	117.380	0,18
100.000	SES SA*	5,63 %	29.12.2049	110.651	0,17
100.000	Southern Co*	1,88 %	15.09.2081	95.010	0,15
87.920	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**	6,00 %	30.07.2026	97.196	0,15
100.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**	2,00 %	15.07.2025	108.314	0,17
100.000	Telecom Italia SpA*	2,38 %	12.10.2027	103.494	0,16
100.000	Telecom Italia SpA*	2,88 %	28.01.2026	107.147	0,16
100.000	Telecom Italia SpA*	7,88 %	31.07.2028	122.993	0,19
100.000	Telefonica Europe BV*	2,88 %	29.12.2049	103.127	0,16
200.000	Telefonica Europe BV*	3,88 %	29.12.2049	214.356	0,33
36.667	Tendam Brands SAU*	11,45 %	31.03.2028	41.253	0,06
150.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,63 %	15.10.2028	141.664	0,22
100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	6,00 %	31.01.2025	111.818	0,17
100.000	Thames Water Utilities Finance Plc*	4,38 %	18.01.2031	104.783	0,16
100.000	Titan Holdings II BV*	5,13 %	15.07.2029	95.140	0,15
92.700	TK Elevator Holdco GmbH**	6,63 %	15.07.2028	94.834	0,14
100.000	TMNL Holding BV**	3,75 %	15.01.2029	105.152	0,16
205.000	Toronto-Dominion Bank*	3,13 %	03.08.2032	221.868	0,34
115.000	Trivium Packaging Finance BV*	3,75 %	15.08.2026	123.323	0,19
150.000	UGI International LLC**	2,50 %	01.12.2029	141.515	0,22
100.000	United Group BV**	5,25 %	01.02.2030	104.982	0,16
270.000	Utah Acquisition Sub Inc*	3,13 %	22.11.2028	290.961	0,44
100.000	Valeo SE*	5,88 %	12.04.2029	118.722	0,18
200.000	Veolia Environnement SA*	2,50 %	29.12.2049	198.274	0,30
200.000	Verisure Holding AB*	3,25 %	15.02.2027	212.622	0,32
100.000	Verisure Midholding AB*	5,25 %	15.02.2029	105.749	0,16
370.000	Verizon Communications Inc*	1,88 %	26.10.2029	381.998	0,58
100.000	Vonovia SE*	0,25 %	01.09.2028	94.018	0,14
100.000	Vonovia SE*	1,00 %	16.06.2033	84.261	0,13
137.000	WEPA Hygieneprodukte GmbH**	2,88 %	15.12.2027	142.079	0,22
100.000	Westlake Corp*	1,63 %	17.07.2029	99.416	0,15
100.000	WMG Acquisition Corp*	2,25 %	15.08.2031	97.205	0,15

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
100.000	ZF Finance GmbH*	3,75 %	21.09.2028	106.842	0,16
100.000	Ziggo Bond Co BV*	3,38 %	28.02.2030	93.579	0,14
	Euro insgesamt			**17.426.821**	**26,65**
	Britisches Pfund				
135.000	AA Bond Co Ltd*	6,50 %	31.01.2026	164.418	0,25
100.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	4,75 %	15.07.2027	93.013	0,14
100.000	B&M European Value Retail SA*	8,13 %	15.11.2030	136.069	0,21
150.000	Barclays Plc*	7,09 %	06.11.2029	203.862	0,31
100.000	Bellis Acquisition Co Plc**	3,25 %	16.02.2026	118.650	0,18
100.000	British Telecommunications Plc*	8,38 %	20.12.2083	134.933	0,21
100.000	Centrica Plc*	5,25 %	10.04.2075	126.209	0,19
100.000	Co-operative Group Holdings 2011 Ltd*	7,50 %	08.07.2026	126.115	0,19
100.000	Coventry Building Society*	7,00 %	07.11.2027	132.839	0,20
112.000	CPUK Finance Ltd**	6,50 %	28.08.2026	138.473	0,21
160.000	Lloyds Banking Group Plc*	2,71 %	03.12.2035	164.651	0,25
120.000	Mobico Group Plc*	4,25 %	29.12.2049	135.464	0,21
600.000	NGG Finance Plc*	5,63 %	18.06.2073	756.133	1,16
200.000	Pension Insurance Corp Plc*	8,00 %	13.11.2033	273.623	0,42
100.000	Pinewood Finance Co Ltd**	3,25 %	30.09.2025	124.222	0,19
100.000	Pinnacle Bidco Plc*	10,00 %	11.10.2028	132.819	0,20
100.000	RAC Bond Co Plc**	5,25 %	04.11.2027	111.898	0,17
100.000	Travis Perkins Plc*	3,75 %	17.02.2026	120.596	0,19
100.000	TVL Finance Plc**	10,25 %	28.04.2028	132.824	0,20
150.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	4,25 %	15.01.2030	167.874	0,26
100.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88 %	15.07.2028	117.653	0,18
100.000	Vodafone Group Plc*	5,90 %	26.11.2032	140.056	0,21
300.000	Volkswagen Financial Services NV*	4,25 %	09.10.2025	376.830	0,58
100.000	Volkswagen Financial Services NV*	6,50 %	18.09.2027	133.353	0,20
172.000	Westfield America Management Ltd*	2,63 %	30.03.2029	189.862	0,29
	Britisches Pfund insgesamt			**4.452.439**	**6,80**
	US-Dollar				
20.000	AbbVie Inc*	4,88 %	14.11.2048	19.527	0,03
200.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC*	4,60 %	02.11.2047	184.066	0,28
70.000	Air Lease Corp*	0,70 %	15.02.2024	69.571	0,11
90.000	Air Lease Corp*	2,30 %	01.02.2025	86.897	0,13
40.000	Amgen Inc**	5,75 %	02.03.2063	42.016	0,07
45.000	Apple Inc**	4,65 %	23.02.2046	44.444	0,07
80.000	AT&T Inc*	3,65 %	01.06.2051	60.312	0,09

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
60.000	Bank of America Corp**	2,50 %	13.02.2031	51.555	0,08
125.000	Bank of America Corp**	2,97 %	04.02.2033	106.403	0,16
110.000	Bank of America Corp**	3,71 %	24.04.2028	105.114	0,16
145.000	Barclays Plc*	2,85 %	07.05.2026	139.862	0,21
100.000	Boeing Co*	5,81 %	01.05.2050	103.625	0,16
100.000	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais**	5,33 %	15.02.2028	98.533	0,15
130.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80 %	01.03.2050	100.796	0,15
15.000	Cigna Corp*	3,20 %	15.03.2040	11.737	0,02
70.000	Citigroup Inc**	2,98 %	05.11.2030	62.380	0,10
95.000	Citigroup Inc**	3,35 %	24.04.2025	94.294	0,14
105.000	Citigroup Inc**	3,52 %	27.10.2028	99.372	0,15
125.000	Citigroup Inc**	3,79 %	17.03.2033	112.469	0,17
165.000	Comcast Corp**	2,94 %	01.11.2056	108.621	0,17
35.000	Corebridge Financial Inc**	4,35 %	05.04.2042	29.735	0,05
30.000	CVS Health Corp*	4,13 %	01.04.2040	25.791	0,04
135.000	CVS Health Corp*	5,05 %	25.03.2048	126.383	0,19
80.000	Discovery Communications LLC**	3,63 %	15.05.2030	72.548	0,11
84.000	DTE Energy Co*	3,40 %	15.06.2029	78.586	0,12
55.000	Duke Energy Corp*	2,55 %	15.06.2031	46.968	0,07
200.000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado*	3,83 %	14.09.2061	137.585	0,21
140.000	EPR Properties**	3,60 %	15.11.2031	116.244	0,18
90.000	Exxon Mobil Corp*	3,45 %	15.04.2051	70.692	0,11
130.000	Goldman Sachs Group Inc**	2,62 %	22.04.2032	109.168	0,17
45.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,27 %	29.09.2025	44.244	0,07
85.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,69 %	05.06.2028	81.252	0,12
105.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,81 %	23.04.2029	99.748	0,15
95.000	Goldman Sachs Group Inc**	4,02 %	31.10.2038	82.958	0,13
80.000	HCA Inc*	5,25 %	15.06.2049	74.469	0,11
60.000	JPMorgan Chase & Co**	2,96 %	13.05.2031	52.753	0,08
50.000	JPMorgan Chase & Co**	3,11 %	22.04.2041	38.531	0,06
200.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,38 %	24.04.2030	198.766	0,30
15.000	L3Harris Technologies Inc*	5,40 %	15.01.2027	15.319	0,02
25.000	L3Harris Technologies Inc*	5,40 %	31.07.2033	26.005	0,04
25.000	L3Harris Technologies Inc*	5,60 %	31.07.2053	26.644	0,04
240.000	Lloyds Banking Group Plc*	3,51 %	18.03.2026	234.508	0,36
55.000	Marathon Petroleum Corp**	4,70 %	01.05.2025	54.673	0,08
100.000	Molson Coors Beverage Co*	4,20 %	15.07.2046	85.358	0,13
105.000	Morgan Stanley**	0,79 %	22.01.2025	104.694	0,16
135.000	Morgan Stanley**	2,70 %	22.01.2031	118.099	0,18
60.000	Morgan Stanley*	3,63 %	20.01.2027	58.203	0,09

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 41,91 % (31. Dezember 2022: 46,55 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
55.000	Morgan Stanley**	5,25 %	21.04.2034	55.020	0,08
30.000	Morgan Stanley**	5,95 %	19.01.2038	30.352	0,05
60.000	MPLX LP*	4,70 %	15.04.2048	51.843	0,08
95.000	Oracle Corp*	4,00 %	15.07.2046	76.315	0,12
55.000	Oracle Corp*	5,55 %	06.02.2053	55.079	0,08
1.360.000	Petroleos de Venezuela SA*	5,38 %	12.04.2027	151.640	0,23
200.000	Petroleos del Peru SA*	5,63 %	19.06.2047	123.395	0,19
109.000	Petroleos Mexicanos**	7,69 %	23.01.2050	77.655	0,12
35.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd*	5,34 %	19.05.2063	35.365	0,05
55.000	Rogers Communications Inc**	3,80 %	15.03.2032	50.630	0,08
115.000	Synchrony Financial*	2,88 %	28.10.2031	92.207	0,14
83.000	Sysco Corp*	6,60 %	01.04.2050	97.544	0,15
95.000	T-Mobile USA Inc**	4,50 %	15.04.2050	84.026	0,13
15.000	Travelers Cos Inc*	5,45 %	25.05.2053	16.201	0,03
120.000	Truist Financial Corp**	5,87 %	08.06.2034	122.495	0,19
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95 %	11.03.2025	148.908	0,23
235.000	Verizon Communications Inc*	2,55 %	21.03.2031	202.694	0,31
80.000	Vodafone Group Plc**	4,88 %	19.06.2049	72.603	0,11
90.000	Warnermedia Holdings Inc**	5,14 %	15.03.2052	77.305	0,12
	US-Dollar insgesamt			**5.532.795**	**8,46**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**27.412.055**	**41,91**
	Staatsanleihen 32,31 % (31. Dezember 2022: 32,47 %)				
	Australischer Dollar				
285.000	New South Wales Treasury Corp*	4,25 %	20.02.2036	185.386	0,28
350.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond**	5,10 %	28.11.2030	246.465	0,38
310.000	Queensland Treasury Corp*	4,50 %	09.03.2033	213.011	0,32
226.000	Queensland Treasury Corp*	5,25 %	21.07.2036	161.892	0,25
	Australischer Dollar insgesamt			**806.754**	**1,23**
	Chinesischer Yuan Renminbi				
7.850.000	China Government Bond**	2,62 %	25.06.2030	1.112.780	1,70
5.980.000	China Government Bond**	2,88 %	25.02.2033	864.016	1,32
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt			**1.976.796**	**3,02**
	Tschechische Krone				
10.460.000	Czech Republic Government Bond*	4,90 %	14.04.2034	514.023	0,79
	Tschechische Krone insgesamt			**514.023**	**0,79**

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 32,31 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung)				
	Euro				
100.000	Andorra International Bond*	1,25 %	23.02.2027	103.386	0,16
83.677	Bundesobligation*	2,20 %	13.04.2028	93.322	0,14
80.000	Bundesobligation*	2,40 %	19.10.2028	90.186	0,14
28.767	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00 %	15.08.2030	28.125	0,04
34.595	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00 %	15.02.2031	33.439	0,05
40.582	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00 %	15.08.2031	38.818	0,06
31.500	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,00 %	15.08.2052	18.564	0,03
162.529	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	0,50 %	15.02.2026	172.948	0,26
338.395	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe*	1,70 %	15.08.2032	366.206	0,56
100.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale*	1,50 %	25.05.2032	101.237	0,15
140.000	Egypt Government International Bond*	6,38 %	11.04.2031	99.686	0,15
83.000	European Union*	0,00 %	06.07.2026	86.223	0,13
72.590	European Union*	1,63 %	04.12.2029	76.550	0,12
68.000	European Union*	2,00 %	04.10.2027	74.016	0,11
32.000	European Union*	2,75 %	04.12.2037	34.721	0,05
44.800	European Union*	3,38 %	04.10.2038	52.023	0,08
44.000	European Union*	3,25 %	04.07.2034	50.980	0,08
113.305	French Republic Government Bond OAT**	0,25 %	25.07.2024	124.322	0,19
20.000	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.02.2028	20.822	0,03
7.341	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.05.2052	4.654	0,01
266.000	French Republic Government Bond OAT*	0,75 %	25.05.2053	165.106	0,25
43.355	French Republic Government Bond OAT*	1,50 %	25.05.2031	45.230	0,07
12.000	French Republic Government Bond OAT*	1,75 %	25.05.2066	9.495	0,01
4.000	Hungary Government International Bond*	1,75 %	05.06.2035	3.403	0,01
200.000	Indonesia Government International Bond*	1,40 %	30.10.2031	187.862	0,29
21.000	Ireland Government Bond**	0,20 %	18.10.2030	20.206	0,03
35.000	Ireland Government Bond*	0,55 %	22.04.2041	27.123	0,04
23.000	Ireland Government Bond*	2,40 %	15.05.2030	25.686	0,04
8.400	Ireland Government Bond*	3,00 %	18.10.2043	9.658	0,01
18.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,00 %	01.08.2026	18.527	0,03
32.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,50 %	15.07.2028	31.744	0,05
263.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,90 %	01.04.2031	245.886	0,38
64.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,95 %	15.09.2027	66.111	0,10
20.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	0,95 %	01.06.2032	18.106	0,03
31.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,20 %	15.08.2025	33.306	0,05
18.989	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,40 %	26.05.2025	20.646	0,03
39.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,60 %	01.06.2026	41.919	0,06
299.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,75 %	30.05.2024	327.570	0,50
11.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,85 %	01.07.2025	11.948	0,02
19.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	2,05 %	01.08.2027	20.454	0,03

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 32,31 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
118.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	3,40 %	28.03.2025	130.748	0,20
49.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	4,35 %	01.11.2033	57.344	0,09
130.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,25 %	22.03.2030	129.260	0,20
110.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,88 %	17.10.2031	109.275	0,17
23.128	Kingdom of Belgium Government Bond*	0,40 %	22.06.2040	17.052	0,03
21.000	Kingdom of Belgium Government Bond*	3,00 %	22.06.2033	24.145	0,04
27.000	Kingdom of Belgium Government Bond*	3,30 %	22.06.2054	30.435	0,05
18.000	Kingdom of Belgium Government Bond*	3,75 %	22.06.2045	22.009	0,03
100.000	Magyar Export-Import Bank Zrt*	6,00 %	16.05.2029	117.490	0,18
100.000	Philippine Government International Bond*	1,75 %	28.04.2041	77.498	0,12
531.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	1,65 %	16.07.2032	543.313	0,83
217.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	2,88 %	15.10.2025	241.461	0,37
35.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT**	2,88 %	21.07.2026	39.348	0,06
30.000	Republic of Poland Government International Bond*	3,88 %	14.02.2033	34.650	0,05
26.000	Romanian Government International Bond*	1,75 %	13.07.2030	23.281	0,04
123.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	28.01.2032	105.509	0,16
15.000	Romanian Government International Bond*	3,62 %	26.05.2030	15.273	0,02
32.000	Romanian Government International Bond*	3,62 %	26.05.2030	32.583	0,05
37.000	Romanian Government International Bond*	3,75 %	07.02.2034	35.343	0,05
90.000	Romanian Government International Bond*	3,88 %	29.10.2035	85.038	0,13
23.000	Romanian Government International Bond*	4,13 %	11.03.2039	21.250	0,03
30.000	Romanian Government International Bond*	6,38 %	18.09.2033	35.112	0,05
47.000	Romanian Government International Bond*	6,63 %	27.09.2029	55.638	0,09
100.000	Serbia International Bond*	2,05 %	23.09.2036	77.148	0,12
18.300	Slovakia Government Bond*	0,38 %	21.04.2036	14.009	0,02
31.000	Slovenia Government Bond*	1,50 %	25.03.2035	29.009	0,04
20.000	Slovenia Government Bond*	3,63 %	11.03.2033	23.394	0,04
37.000	Spain Government Bond*	1,30 %	31.10.2026	39.513	0,06
14.000	Spain Government Bond*	1,40 %	30.04.2028	14.762	0,02
24.000	Spain Government Bond*	1,85 %	30.07.2035	23.340	0,04
35.000	Spain Government Bond*	3,15 %	30.04.2033	39.349	0,06
18.000	Spain Government Bond*	3,55 %	31.10.2033	20.836	0,03
80.000	Spain Government Bond*	3,55 %	31.10.2033	92.604	0,14
70.000	State of North Rhine-Westphalia Germany*	1,45 %	16.02.2043	59.843	0,09
12.000	State of North Rhine-Westphalia Germany*	1,65 %	22.02.2038	11.412	0,02
	Euro insgesamt			**5.428.488**	**8,29**
	Ungarischer Forint				
108.060.000	Hungary Government Bond*	4,75 %	24.11.2032	288.139	0,44
	Ungarischer Forint insgesamt			**288.139**	**0,44**

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 32,31 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung)				
	Indonesische Rupiah				
5.237.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,38 %	15.04.2032	335.493	0,51
18.973.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.02.2033	1.278.111	1,96
	Indonesische Rupiah insgesamt			**1.613.604**	**2,47**
	Mexikanischer Peso				
29.200.000	Mexican Bonos*	7,50 %	26.05.2033	1.574.217	2,41
23.900.000	Mexican Bonos*	7,75 %	29.05.2031	1.317.213	2,01
	Mexikanischer Peso insgesamt			**2.891.430**	**4,42**
	Neuseeländischer Dollar				
5.143.000	New Zealand Government Bond*	3,50 %	14.04.2033	3.053.390	4,67
	Neuseeländischer Dollar insgesamt			**3.053.390**	**4,67**
	Polnischer Zloty				
2.426.000	Republic of Poland Government Bond*	6,00 %	25.10.2033	654.745	1,00
1.164.000	Republic of Poland Government Bond*	7,50 %	25.07.2028	325.964	0,50
	Polnischer Zloty insgesamt			**980.709**	**1,50**
	Britisches Pfund				
612.000	United Kingdom Gilt*	1,25 %	31.07.2051	413.338	0,63
	Britisches Pfund insgesamt			**413.338**	**0,63**
	Südkoreanischer Won				
308.330.000	Korea Treasury Bond*	4,25 %	10.12.2032	258.205	0,40
	Südkoreanischer Won insgesamt			**258.205**	**0,40**
	Thailändischer Baht				
9.569.000	Thailand Government Bond**	2,00 %	17.12.2031	267.740	0,41
	Thailändischer Baht insgesamt			**267.740**	**0,41**
	US-Dollar				
200.000	Angolan Government International Bond*	8,75 %	14.04.2032	176.445	0,27
100.000	Argentine Republic Government International Bond*	0,75 %	09.07.2030	40.351	0,06
30.000	Argentine Republic Government International Bond*	1,00 %	09.07.2029	12.060	0,02
260.000	Argentine Republic Government International Bond*	3,63 %	09.07.2035	89.847	0,14
200.000	Colombia Government International Bond*	6,13 %	18.01.2041	182.448	0,28
160.000	Dominican Republic International Bond*	4,88 %	23.09.2032	146.096	0,22
14.629	Ecuador Government International Bond*	0,00 %	31.07.2030	4.209	0,01
3.972	Ecuador Government International Bond*	2,50 %	31.07.2040	1.271	0,00

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 32,31 % (31. Dezember 2022: 32,47 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
153.501	Ecuador Government International Bond*	3,50 %	31.07.2035	55.312	0,09
30.932	Ecuador Government International Bond*	6,00 %	31.07.2030	14.455	0,02
227.000	El Salvador Government International Bond*	7,65 %	15.06.2035	177.911	0,27
200.000	Ghana Government International Bond*	7,63 %	16.05.2029	87.711	0,13
112.000	Lebanon Government International Bond*	6,38 %	09.03.2020	6.860	0,01
220.000	Lebanon Government International Bond*	6,60 %	27.11.2026	13.533	0,02
108.000	Lebanon Government International Bond*	6,65 %	26.02.2030	6.767	0,01
62.000	Lebanon Government International Bond*	8,25 %	17.05.2034	3.861	0,01
80.000	Mexico Government International Bond*	5,75 %	12.10.2110	71.894	0,11
200.000	Nigeria Government International Bond*	8,38 %	24.03.2029	192.509	0,29
200.000	Panama Government International Bond*	2,25 %	29.09.2032	146.320	0,22
200.000	Republic of South Africa Government International Bond*	7,30 %	20.04.2052	189.981	0,29
200.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,75 %	18.04.2028	101.112	0,16
200.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,85 %	14.03.2029	101.016	0,15
150.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2029	41.596	0,06
525.000	United States Treasury Note/Bond*	0,25 %	15.06.2024	513.547	0,79
126.000	United States Treasury Note/Bond*	2,00 %	15.08.2051	82.323	0,13
60.000	United States Treasury Note/Bond*	3,50 %	15.02.2039	56.856	0,09
200.000	Zambia Government International Bond*	8,97 %	30.07.2027	124.476	0,19
	US-Dollar insgesamt			**2.640.767**	**4,04**
	Staatsanleihen insgesamt			**21.133.383**	**32,31**
	Mortgage-Backed Securities 22,27 % (31. Dezember 2022: 13,74 %)				
	US-Dollar				
224.126	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.09.2051	190.769	0,29
127.127	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.10.2051	108.413	0,17
308.131	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.01.2052	262.241	0,40
488.382	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.03.2052	415.896	0,64
197.718	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.04.2052	168.361	0,26
55.002	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.11.2045	50.256	0,08
46.434	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.08.2046	42.197	0,06
70.952	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.01.2050	63.531	0,10
86.745	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.03.2050	77.471	0,12
76.337	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.04.2050	68.176	0,10
46.597	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.07.2051	41.256	0,06
169.360	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.02.2052	149.958	0,23
36.962	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.03.2047	34.509	0,05
58.307	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.09.2047	54.438	0,08
69.459	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.02.2048	64.851	0,10
242.073	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.05.2052	223.008	0,34

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 22,27 % (31. Dezember 2022: 13,74 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
72.922	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2048	70.224	0,11
22.124	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.10.2048	21.281	0,03
64.692	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2049	62.098	0,09
183.155	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.04.2052	173.411	0,26
109.125	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.06.2052	103.266	0,16
118.347	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2052	112.634	0,17
289.129	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.08.2052	273.605	0,42
332.161	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.09.2052	322.212	0,49
463.926	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.10.2052	450.031	0,69
590.124	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.01.2053	572.449	0,87
133.380	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.08.2052	132.179	0,20
69.854	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.11.2052	69.204	0,11
411.482	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.01.2053	407.724	0,62
228.373	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.04.2053	226.021	0,35
455.278	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.01.2053	457.435	0,70
282.508	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.02.2053	283.856	0,43
216.239	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.07.2053	217.504	0,33
308.825	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.07.2053	313.642	0,48
82.800	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.10.2053	84.226	0,13
72.827	Fannie Mae Pool (BH9277)	3,50 %	01.02.2048	67.995	0,10
82.458	Fannie Mae Pool (CB4020)	4,00 %	01.07.2052	78.009	0,12
78.501	Fannie Mae Pool (MA4655)	4,00 %	01.07.2052	74.332	0,11
394.225	Fannie Mae Pool (MA4700)	4,00 %	01.08.2052	373.037	0,57
183.723	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.12.2050	156.509	0,24
81.049	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.08.2051	69.104	0,11
199.052	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.09.2051	169.508	0,26
89.568	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.01.2052	76.268	0,12
289.170	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.02.2052	246.230	0,38
273.545	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.03.2052	233.018	0,36
300.337	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.04.2052	255.721	0,39
18.351	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.03.2050	16.542	0,03
99.378	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.07.2050	88.853	0,14
56.305	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.01.2052	50.255	0,08
49.312	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.04.2052	45.226	0,07
216.178	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.05.2052	198.367	0,30
342.188	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.09.2052	323.785	0,49
26.493	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.07.2052	25.700	0,04
570.368	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.08.2052	553.284	0,85
185.376	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.11.2052	183.706	0,28
146.375	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.01.2053	144.921	0,22

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 22,27 % (31. Dezember 2022: 13,74 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
267.009	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.02.2053	264.259	0,40
258.254	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.04.2053	255.594	0,39
181.861	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.09.2052	183.207	0,28
195.306	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.10.2052	196.567	0,30
116.329	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.02.2053	116.965	0,18
259.842	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.05.2053	260.994	0,40
116.451	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.03.2053	118.310	0,18
323.313	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.04.2053	328.406	0,50
499.569	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.05.2053	507.579	0,78
384.926	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.06.2053	390.991	0,60
77.976	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.09.2053	79.421	0,12
203.740	Freddie Mac Pool (QE2363)	3,50 %	01.05.2052	186.881	0,29
239.931	Freddie Mac Pool (RA7384)	3,50 %	01.05.2052	220.083	0,34
350.000	Ginnie Mae	5,00 %	01.01.2054	347.594	0,53
495.000	Ginnie Mae	5,50 %	01.01.2054	498.636	0,76
187.474	Ginnie Mae II Pool	2,50 %	20.05.2052	163.972	0,25
140.856	Ginnie Mae II Pool	4,50 %	20.09.2052	137.548	0,21
155.074	Ginnie Mae II Pool	5,00 %	20.03.2053	154.114	0,24
34.627	Ginnie Mae II Pool	5,00 %	20.07.2053	34.381	0,05
154.132	Ginnie Mae II Pool	5,50 %	20.03.2053	155.326	0,24
163.448	Ginnie Mae II Pool	6,00 %	20.08.2053	166.271	0,25
	Mortgage-Backed Securities insgesamt **			**14.565.802**	**22,27**

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Investmentfonds 0.03 % (31. Dezember 2022: 2,37 %)		
	Britisches Pfund		
23.786	NB Global Monthly Income Fund Ltd	21.165	0,03
	Investmentfonds insgesamt ‡	**21.165**	**0,03**
	Anlagen insgesamt	**64.950.148**	**99,30**

Devisenterminkontrakte 7,14 % (31. Dezember 2022: 2,72 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
2.145.436 AUD	1.370.700 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	94.001	0,14
7.990.660 AUD	5.104.895 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	350.371	0,54
220.000 AUD	144.454 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	5.741	0,01
4.358.213 AUD	2.810.182 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	5	165.192	0,25

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 7,14 % (31. Dezember 2022: 2,72 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
452.490 AUD	294.254 US$	18.01.2024	UBS AG	1	14.663	0,02
5.491.940 AUD	3.494.505 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	254.872	0,39
5.661.591 BRL	1.108.457 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	55.788	0,09
1.784.234 CAD	1.295.991 US$	18.01.2024	BNP Paribas	2	57.444	0,09
5.082.746 CAD	3.712.059 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	143.471	0,22
458.979 CAD	341.728 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	6.431	0,01
2.201.907 CAD	1.600.103 US$	18.01.2024	UBS AG	4	70.159	0,11
433.481 CAD	319.760 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	9.058	0,01
2.286.909 CHF	2.558.950 US$	18.01.2024	BNP Paribas	3	162.657	0,25
2.027.231 CHF	2.278.924 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	133.644	0,20
592.616 CHF	666.910 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	38.351	0,06
606.436 CHF	679.341 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	42.367	0,06
1.709.480 CHF	1.956.328 US$	18.01.2024	UBS AG	2	78.092	0,12
139.401 CHF	156.416 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	9.483	0,01
296.144.461 CLP	319.070 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	19.785	0,03
581.556.016 CLP	622.651 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	42.777	0,07
15.284.327 CNY	2.103.404 US$	18.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	45.426	0,07
5.242 CNY	721 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	16	0,00
1.264.984 CNY	178.169 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	528	0,00
14.848.597 CZK	639.008 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	25.035	0,04
7.412.140 CZK	328.078 US$	18.01.2024	UBS AG	1	3.399	0,01
7.230.274 €	7.710.490 US$	18.01.2024	BNP Paribas	8	281.403	0,43
200.000 €	220.419 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	648	0,00
4.203.304 €	4.518.012 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	8	128.057	0,20
43.822 €	47.008 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	1.431	0,00
532.290 €	565.741 US$	18.01.2024	Société Générale	1	22.619	0,03
895.425 €	962.375 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	3	27.372	0,04
4.273.094 €	4.555.707 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	167.504	0,26
1.804.821 €	1.965.592 US$	18.01.2024	UBS AG	2	29.345	0,05
460.752 €	490.601 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	18.685	0,03
1.576.689 £	1.928.962 US$	18.01.2024	BNP Paribas	3	81.178	0,12
114.648 £	142.994 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	2	3.172	0,01
1.869.817 £	2.292.014 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	91.838	0,14
300.000 £	379.884 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	2.590	0,00
266.136 £	328.329 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	10.971	0,02
40.000 £	45.696 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	487	0,00
673.299 £	834.443 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	23.954	0,04
1.397.783 £	1.739.681 US$	18.01.2024	UBS AG	3	42.369	0,07
15.000.000 HUF	42.848 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	407	0,00
176.136.407 HUF	487.327 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	20.596	0,03

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 7,14 % (31. Dezember 2022: 2,72 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
58.285.727 HUF	156.943 US$	18.01.2024	Société Générale	1	11.135	0,02
115.943.232 HUF	328.803 US$	18.01.2024	UBS AG	1	5.541	0,01
4.844.779 IDR	307 US$	18.01.2024	UBS AG	1	7	0,00
141.441.607 ¥	964.920 US$	18.01.2024	BNP Paribas	2	40.773	0,06
423.870.733 ¥	2.855.502 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	158.351	0,24
6.596.939 ¥	45.195 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	1.711	0,00
371.424.510 ¥	2.534.326 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	106.618	0,16
93.862.694 ¥	664.761 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	2.632	0,00
146.969.225 ¥	985.946 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	59.050	0,09
564.067.131 KRW	423.442 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	11.814	0,02
3.528.943 MXN	190.767 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	17.079	0,03
1.500.000 MXN	86.001 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	2.346	0,00
35.626.106 MXN	1.937.255 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	161.035	0,25
11.415.118 MXN	644.740 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	27.583	0,04
12.157.863 NOK	1.123.341 US$	18.01.2024	BNP Paribas	4	74.289	0,11
3.481.628 NOK	322.862 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	20.101	0,03
5.407.021 NOK	489.906 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	42.721	0,07
3.836.976 NOK	342.654 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	35.313	0,05
31.114.421 NOK	2.846.513 US$	18.01.2024	UBS AG	4	218.463	0,33
544.667 NZD	328.047 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	16.829	0,03
100.000 NZD	61.170 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	2.149	0,00
3.834.329 NZD	2.250.210 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	177.644	0,27
3.841.342 NZD	2.246.423 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	5	185.872	0,28
2.383.799 NZD	1.421.445 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	87.949	0,13
2.736.454 PLN	665.255 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	30.501	0,05
500.000 PLN	123.939 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	3.188	0,01
1.350.517 PLN	325.136 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	18.239	0,03
4.000.489 PLN	958.662 US$	18.01.2024	UBS AG	3	58.480	0,09
19.224.962 SEK	1.756.700 US$	18.01.2024	BNP Paribas	4	152.161	0,23
12.722.883 SEK	1.164.015 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	99.250	0,15
6.337.484 SEK	584.423 US$	18.01.2024	Société Générale	2	44.831	0,07
7.917.996 SEK	774.110 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	12.074	0,02
41.653 US$	65.685 NZD	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	62	0,00
40.733 US$	52.350.320 KRW	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	338	0,00
39.678 US$	886.840 CZK	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	18	0,00
829.437 ZAR	42.999 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	2.296	0,00
49.498 ZAR	2.564 US$	18.01.2024	Société Générale	1	139	0,00

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 7,14 % (31. Dezember 2022: 2,72 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
366 €	397 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	8	0,00
144 €	152 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	7	0,00
457 €	493 US$	18.01.2024	UBS AG	4	13	0,00
14.253 €	15.192 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	6	562	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
469 £	581 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	16	0,00
10.529 £	12.933 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	490	0,00
10.840 £	13.308 US$	18.01.2024	UBS AG	3	513	0,00
1.285 £	1.597 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	41	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**4.673.609**	**7,14**

Futures-Kontrakte 1,28 % (31. Dezember 2022: 0,75 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
46	10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2024	41.105	0,06
3	Australian Government Bond 10-Year Future March 2024	2.452	0,00
19	Canadian 10-Year Bond Future March 2024	86.455	0,13
5	Canadian 5-Year Bond Future March 2024	11.490	0,02
22	Euro-Bund Future March 2024	94.293	0,14
2	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024	23.949	0,04
43	Euro-Schatz Future March 2024	30.279	0,05
7	United Kingdom Long Gilt Future March 2024	57.646	0,09
25	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	92.828	0,14
39	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024	70.296	0,11
75	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	171.814	0,26
9	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024	90.492	0,14
9	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	65.945	0,10
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**839.044**	**1,28**

Zinsswap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,02 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
CNY 16.892.000	17.08.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,05 %	7D CNRR	76	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten ∞						**76**	**0,00**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,30 % (31. Dezember 2022: 0,60 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert USD	% des Nettover-mögens
USD (6.343.750)	20.12.2028	ICE Clear U.S.[1]	Buying default protection on CDX.EM.40	193.716	0,30
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt ±				**193.716**	**0,30**

[1]Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**70.656.593**	**108,02**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (10,06 %) (31. Dezember 2022: (6,38 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
94.000 €	81.871 £	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(477)	(0,00)
30.000 £	34.673 €	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(78)	(0,00)
1.959.318 US$	21.603.742 NOK	18.01.2024	BNP Paribas	4	(168.793)	(0,26)
961.150 US$	17.390.420 MXN	18.01.2024	BNP Paribas	2	(63.103)	(0,10)
1.612.649 US$	2.715.052 NZD	18.01.2024	BNP Paribas	3	(106.492)	(0,16)
3.204.343 US$	2.994.310 €	18.01.2024	BNP Paribas	4	(105.381)	(0,16)
3.038.203 US$	2.703.866 CHF	18.01.2024	BNP Paribas	5	(179.616)	(0,27)
971.625 US$	789.158 £	18.01.2024	BNP Paribas	2	(34.481)	(0,05)
1.437.820 US$	15.639.190 SEK	18.01.2024	BNP Paribas	4	(115.007)	(0,18)
2.457.009 US$	359.495.222 ¥	18.01.2024	BNP Paribas	3	(99.114)	(0,15)
158.998 US$	58.309.235 HUF	18.01.2024	BNP Paribas	1	(9.148)	(0,01)
3.265.953 US$	4.469.389 CAD	18.01.2024	BNP Paribas	6	(124.315)	(0,19)
3.262.382 US$	5.066.240 AUD	18.01.2024	BNP Paribas	6	(196.367)	(0,30)
274.987 US$	256.661.581 CLP	18.01.2024	BNP Paribas	1	(18.691)	(0,03)
965.669 US$	4.068.270 PLN	18.01.2024	BNP Paribas	2	(68.706)	(0,11)
321.256 US$	252.708 £	18.01.2024	Citibank NA	1	(925)	(0,00)
100.816 US$	1.822.432 MXN	18.01.2024	Deutsche Bank AG	2	(6.520)	(0,01)
25.327 US$	9.000.000 HUF	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(626)	(0,00)
3.083.291 US$	2.511.188 £	18.01.2024	Deutsche Bank AG	4	(118.253)	(0,18)
111.990 US$	1.167.994 SEK	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(3.981)	(0,01)
40.262 US$	55.570 CAD	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(1.890)	(0,00)
310.778 US$	286.969 €	18.01.2024	Deutsche Bank AG	3	(6.420)	(0,01)
36.722 US$	708.353 ZAR	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(1.961)	(0,00)
1.186.996 US$	21.174.504 MXN	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(60.131)	(0,09)
805.625 US$	4.023.499 BRL	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	(21.764)	(0,03)

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (10,06 %) (31. Dezember 2022: (6,38 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
40.697 US$	54.750.729 KRW	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(1.551)	(0,00)
2.110.365 US$	15.244.013 CNY	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(43.061)	(0,07)
491.983 US$	7.602.613.380 IDR	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(1.162)	(0,00)
3.810.274 US$	41.323.277 SEK	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	(292.749)	(0,45)
2.844.609 US$	4.409.448 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	(165.745)	(0,25)
2.634.019 US$	3.623.140 CAD	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(114.323)	(0,18)
957.313 US$	4.019.164 PLN	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(64.577)	(0,10)
162.092 US$	1.163.583 CNY	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(1.497)	(0,00)
2.137.343 US$	1.737.262 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(77.513)	(0,12)
3.896.936 US$	6.502.032 NZD	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(220.078)	(0,34)
1.289.916 US$	190.320.578 ¥	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(63.322)	(0,10)
1.141.541 US$	1.028.332 CHF	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(82.257)	(0,13)
3.004.878 US$	2.821.896 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	(114.269)	(0,17)
520.117 US$	8.040.424.826 IDR	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(1.426)	(0,00)
56.604 US$	73.398.220 KRW	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(33)	(0,00)
43.906 US$	6.286.726 ¥	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(794)	(0,00)
1.630.509 US$	30.164.306 MXN	18.01.2024	Royal Bank of Canada	2	(146.094)	(0,22)
3.304.986 US$	2.696.750 £	18.01.2024	Société Générale	1	(133.133)	(0,20)
281.381 US$	104.500.000 HUF	18.01.2024	Société Générale	1	(19.964)	(0,03)
474 US$	5.143 SEK	18.01.2024	Société Générale	1	(36)	(0,00)
1.767.706 US$	18.752.684 SEK	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(94.263)	(0,14)
489.453 US$	652.000.000 KRW	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(13.656)	(0,02)
13.490 US$	97.384 CNY	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(267)	(0,00)
640.752 US$	595.899.549 CLP	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(41.088)	(0,06)
19.131 US$	30.000 AUD	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(1.351)	(0,00)
3.622.637 US$	3.417.089 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	5	(154.399)	(0,24)
51.476 US$	82.793 NZD	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(948)	(0,00)
1.648.482 US$	1.351.942 £	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(75.126)	(0,12)
1.630.200 US$	2.238.233 CAD	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(67.618)	(0,10)
1.045.870 US$	153.180.234 ¥	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(43.289)	(0,07)
2.099.388 US$	15.281.448 CNY	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(49.037)	(0,08)
28.332.315 US$	26.602.213 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	11	(1.072.111)	(1,64)
165.221 US$	58.955.378 HUF	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(4.788)	(0,01)
94.541 US$	374.621 PLN	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(708)	(0,00)
88.064 US$	118.428 CAD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(1.770)	(0,00)
729.707 US$	103.498.103 ¥	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(6.197)	(0,01)
373.372 US$	6.562.485 MXN	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(13.142)	(0,02)
2.309.504 US$	1.877.908 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	6	(84.662)	(0,13)
2.290.213 US$	3.523.578 AUD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	5	(115.352)	(0,18)
1.946.179 US$	1.743.815 CHF	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(129.101)	(0,20)
984.369 US$	10.764.007 NOK	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(75.956)	(0,12)

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (10,06 %) (31. Dezember 2022: (6,38 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
560.045 US$	918.473 NZD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	6	(21.522)	(0,03)
1.635.028 US$	18.012.086 SEK	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	4	(153.405)	(0,23)
1.082.408 US$	25.170.465 CZK	18.01.2024	UBS AG	4	(43.239)	(0,07)
618.106 US$	9.745.387.621 IDR	18.01.2024	UBS AG	1	(14.030)	(0,02)
373.666 US$	3.915.056 SEK	18.01.2024	UBS AG	1	(15.063)	(0,02)
671.566 US$	1.111.912 NZD	18.01.2024	UBS AG	1	(32.484)	(0,05)
1.623.068 US$	17.807.754 NOK	18.01.2024	UBS AG	2	(131.113)	(0,20)
1.283.974 US$	188.942.539 ¥	18.01.2024	UBS AG	1	(59.466)	(0,09)
45.150 US$	35.622 £	18.01.2024	UBS AG	1	(265)	(0,00)
6.120.864 US$	5.402.953 CHF	18.01.2024	UBS AG	4	(309.087)	(0,47)
321.005 US$	117.115.360 HUF	18.01.2024	UBS AG	1	(16.720)	(0,03)
2.680.610 US$	2.501.258 €	18.01.2024	UBS AG	4	(84.123)	(0,13)
952.705 US$	4.154.450 PLN	18.01.2024	UBS AG	2	(103.583)	(0,16)
3.223.389 US$	5.390.193 NZD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(189.620)	(0,29)
2.564.109 US$	4.023.250 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(182.585)	(0,28)
247.436 US$	9.000.000 THB	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(16.604)	(0,03)
815.093 US$	668.870 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(37.657)	(0,06)
1.506.493 US$	1.415.149 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	8	(57.725)	(0,09)
503.563 US$	8.700.000 MXN	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(8.846)	(0,01)
Abgesicherte Klassen EUR						
84 €	93 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(0)	(0,00)
206 US$	195 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(9)	(0,00)
97 US$	89 €	18.01.2024	UBS AG	1	(1)	(0,00)
165 US$	154 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(5)	(0,00)
Abgesicherte Klassen GBP						
208 £	266 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(1)	(0,00)
367 US$	302 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(18)	(0,00)
457 US$	368 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(12)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞]					**(6.577.836)**	**(10,06)**

Futures-Kontrakte (0,54 %) (31. Dezember 2022: (0,80 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
2	Euro-BOBL Call Option on Future February 2024, Strike Price EUR 118	(435)	(0,00)
(5)	Euro-BOBL Future March 2024	(155)	(0,00)
(24)	Euro-BTP Future March 2024	(107.990)	(0,16)
(11)	Euro-OAT Future March 2024	(53.399)	(0,08)
(39)	US Treasury 10-Year Ultra Future March 2024	(194.594)	(0,30)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten [±]		**(356.573)**	**(0,54)**

Global Opportunistic Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Credit-Default-Swap-Kontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (0,09 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
EUR	9.282.000	20.12.2028	ICE Clear U.S.[1]	Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S40	(821.571)	(1,26)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt ±					**(821.571)**	**(1,26)**

[1]Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)[#]	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
KRW	1.267.973.000	11.08.2032	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,88 %	3M KORIBOR	(7)	(0,00)
KRW	730.294.000	18.02.2032	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,37 %	3M KORIBOR	(20)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten ∞							**(27)**	**(0,00)**

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(7.756.007)**	**(11,86)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**62.900.586**	**96,16**
Sonstiges Nettovermögen	**2.509.177**	**3,84**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**65.409.763**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	37.941.278	51,13
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	26.810.069	36,13
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	177.636	0,24
µ	Investmentfonds	21.165	0,03
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	482.471	0,65
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(2.532.033)	(3,41)
Anlagen insgesamt		**62.900.586**	**84,77**

Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 14,74 % (31. Dezember 2022: 17,55 %)		
	Kanadischer Dollar		
12.807	Tricon Residential Inc	117.134	0,57
	Kanadischer Dollar insgesamt	**117.134**	**0,57**
	Euro		
3.988	Cellnex Telecom SA	157.095	0,77
	Euro insgesamt	**157.095**	**0,77**
	Hongkong-Dollar		
38.000	CK Asset Holdings Ltd	190.765	0,94
322.000	Sino Land Co Ltd	350.101	1,71
22.883	Sun Hung Kai Properties Ltd	247.481	1,21
	Hongkong-Dollar insgesamt	**788.347**	**3,86**
	Japanischer Yen		
20.500	Mitsui Fudosan Co Ltd	502.830	2,46
8.600	Nomura Real Estate Holdings Inc	226.255	1,10
	Japanischer Yen insgesamt	**729.085**	**3,56**
	Britisches Pfund		
113.868	Grainger Plc	383.800	1,87
	Britisches Pfund insgesamt	**383.800**	**1,87**
	Singapur-Dollar		
112.500	UOL Group Ltd	535.593	2,62
	Singapur-Dollar insgesamt	**535.593**	**2,62**
	Schweizer Franken		
1.099	PSP Swiss Property AG	153.558	0,75
1.418	Swiss Prime Site AG	151.378	0,74
	Schweizer Franken insgesamt	**304.936**	**1,49**
	Aktien insgesamt *	**3.015.990**	**14,74**
	Immobilienaktiengesellschaften 83,44 % (31. Dezember 2022: 77,80 %)		
	Australischer Dollar		
119.489	Charter Hall Retail REIT	294.335	1,44
69.376	GPT Group	219.652	1,08
340.133	Region RE Ltd	524.523	2,56
	Australischer Dollar insgesamt	**1.038.510**	**5,08**

Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Immobilienaktiengesellschaften 83,44 % (31. Dezember 2022: 77,80 %) (Fortsetzung)		
	Kanadischer Dollar		
8.631	Canadian Apartment Properties REIT	319.424	1,56
27.678	RioCan Real Estate Investment Trust	390.842	1,91
	Kanadischer Dollar insgesamt	**710.266**	**3,47**
	Euro		
3.283	Gecina SA	399.285	1,95
33.876	Merlin Properties Socimi SA	376.456	1,84
7.014	Shurgard Self Storage Ltd	347.576	1,70
2.829	Unibail-Rodamco-Westfield	209.129	1,02
	Euro insgesamt	**1.332.446**	**6,51**
	Hongkong-Dollar		
28.860	Link REIT	162.068	0,79
	Hongkong-Dollar insgesamt	**162.068**	**0,79**
	Japanischer Yen		
359	LaSalle Logiport REIT	387.062	1,89
54	Nippon Building Fund Inc	234.033	1,15
202	Nippon Prologis REIT Inc	388.870	1,90
	Japanischer Yen insgesamt	**1.009.965**	**4,94**
	Britisches Pfund		
26.977	Great Portland Estates Plc	144.439	0,71
26.892	Segro Plc	303.875	1,48
26.383	UNITE Group Plc	351.129	1,72
	Britisches Pfund insgesamt	**799.443**	**3,91**
	Singapur-Dollar		
167.400	Mapletree Pan Asia Commercial Trust	199.240	0,97
	Singapur-Dollar insgesamt	**199.240**	**0,97**
	US-Dollar		
1.361	American Homes 4 Rent Class A	48.941	0,24
5.174	American Tower Corp	1.116.963	5,46
10.018	Apartment Income REIT Corp	347.925	1,70
1.260	AvalonBay Communities Inc	235.897	1,15
2.172	Boston Properties Inc	152.409	0,74
4.861	Crown Castle Inc	559.939	2,74

Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Immobilienaktiengesellschaften 83,44 % (31. Dezember 2022: 77,80 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
521	EastGroup Properties Inc	95.624	0,47
999	Equinix Inc	804.585	3,93
3.196	Equity LifeStyle Properties Inc	225.446	1,10
4.640	Equity Residential	283.782	1,39
1.574	Essex Property Trust Inc	390.258	1,91
3.244	Extra Space Storage Inc	520.110	2,54
38.790	Hudson Pacific Properties Inc	361.135	1,76
3.092	Invitation Homes Inc	105.468	0,51
4.498	Iron Mountain Inc	314.770	1,54
22.399	Kimco Realty Corp	477.323	2,33
4.930	Omega Healthcare Investors Inc	151.154	0,74
7.257	Prologis Inc	967.358	4,73
3.067	Public Storage	935.435	4,57
7.694	Realty Income Corp	441.790	2,16
7.002	Retail Opportunity Investments Corp	98.238	0,48
2.623	Rexford Industrial Realty Inc	147.150	0,72
1.726	SBA Communications Corp Class A	437.869	2,14
4.130	Simon Property Group Inc	589.103	2,88
2.464	Sun Communities Inc	329.314	1,61
7.790	Urban Edge Properties	142.557	0,70
6.939	Ventas Inc	345.840	1,69
12.523	VICI Properties Inc Class A	399.233	1,95
5.326	Welltower Inc	480.245	2,35
9.027	Weyerhaeuser Co	313.869	1,54
	US-Dollar insgesamt	**11.819.730**	**57,77**
	Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *	**17.071.668**	**83,44**
	Anlagen insgesamt	**20.087.658**	**98,18**

Devisenterminkontrakte 2,07 % (31. Dezember 2022: 2,22 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
456.034 €	494.179 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	9.892	0,06
5.361.355 €	5.718.455 US$	18.01.2024	UBS AG	10	207.653	1,01
5.128.261 €	5.467.788 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	23	200.670	0,98
Abgesicherte Klassen GBP						
4.198 £	5.177 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	175	0,00
78.915 £	97.015 US$	18.01.2024	UBS AG	5	3.596	0,02
16.620 £	20.698 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	14	492	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**422.478**	**2,07**

Global Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**20.510.136**	**100,25**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (1,23 %) (31. Dezember 2022: (0,38 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
15.291 €	16.935 US$	18.01.2024	UBS AG	2	(33)	(0,00)
423.551 US$	395.459 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(13.564)	(0,07)
264.014 US$	245.621 €	18.01.2024	UBS AG	3	(7.481)	(0,04)
10.197.162 US$	9.432.620 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	22	(229.066)	(1,12)
Abgesicherte Klassen GBP						
2.137 £	2.733 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(9)	(0,00)
584 £	745 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
4.003 US$	3.262 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(155)	(0,00)
4.678 US$	3.775 £	18.01.2024	UBS AG	4	(135)	(0,00)
6.444 US$	5.242 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	(241)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(250.684)**	**(1,23)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(250.684)**	**(1,23)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**20.259.452**	**99,02**
Sonstiges Nettovermögen	**200.561**	**0,98**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**20.460.013**	**100,00**

Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtver-mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	20.087.658	96,40
∞ OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	171.794	0,82
Anlagen insgesamt	**20.259.452**	**97,22**

Global Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 99,37 % (31. Dezember 2022: 99,20 %)		
	Dänische Krone		
22.781	Novo Nordisk A/S Class B	2.356.638	1,52
	Dänische Krone insgesamt	**2.356.638**	**1,52**
	Euro		
2.206	Adyen NV	2.842.838	1,84
48.948	Alfen NV	3.259.364	2,11
4.904	ASML Holding NV	3.692.908	2,39
93.223	HelloFresh SE	1.473.626	0,95
5.575	L'Oreal SA	2.775.294	1,79
17.603	Schneider Electric SE	3.534.740	2,29
	Euro insgesamt	**17.578.770**	**11,37**
	Japanischer Yen		
66.400	Recruit Holdings Co Ltd	2.808.506	1,82
	Japanischer Yen insgesamt	**2.808.506**	**1,82**
	Norwegische Krone		
73.159	Bakkafrost P/F	3.832.389	2,48
	Norwegische Krone insgesamt	**3.832.389**	**2,48**
	Britisches Pfund		
146.702	3i Group Plc	4.527.650	2,93
	Britisches Pfund insgesamt	**4.527.650**	**2,93**
	Schwedische Krone		
89.486	Assa Abloy AB Class B	2.577.711	1,67
103.374	Atlas Copco AB Class A	1.780.197	1,15
	Schwedische Krone insgesamt	**4.357.908**	**2,82**
	Schweizer Franken		
37.517	Nestle SA	4.346.560	2,81
2.444	Partners Group Holding AG	3.522.333	2,28
17.303	Straumann Holding AG	2.787.723	1,80
2.871	VAT Group AG	1.437.803	0,93
	Schweizer Franken insgesamt	**12.094.419**	**7,82**
	US-Dollar		
20.671	Abbott Laboratories	2.275.257	1,47
5.300	Adobe Inc	3.161.980	2,05
62.390	Alphabet Inc Class A	8.715.259	5,64

Global Sustainable Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 99,37 % (31. Dezember 2022: 99,20 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
51.146	Amazon.com Inc	7.771.123	5,03
16.993	Applied Materials Inc	2.754.056	1,78
40.721	Brown & Brown Inc	2.895.670	1,87
10.445	Danaher Corp	2.416.346	1,56
6.836	Elevance Health Inc	3.223.584	2,09
21.604	Estee Lauder Cos Inc Class A	3.159.585	2,04
5.826	Intuit Inc	3.641.425	2,36
8.607	Mastercard Inc Class A	3.670.972	2,37
35.979	Microsoft Corp	13.529.543	8,75
7.668	Moody's Corp	2.994.814	1,94
46.994	Nasdaq Inc	2.732.231	1,77
10.556	Netflix Inc	5.139.505	3,32
39.483	NIKE Inc Class B	4.286.669	2,77
6.537	Nordson Corp	1.726.814	1,12
7.934	S&P Global Inc	3.495.086	2,26
21.006	SolarEdge Technologies Inc	1.966.162	1,27
38.518	Starbucks Corp	3.698.113	2,39
5.919	Synopsys Inc	3.047.752	1,97
8.810	Thermo Fisher Scientific Inc	4.676.260	3,03
6.768	Ulta Beauty Inc	3.316.252	2,15
10.310	UnitedHealth Group Inc	5.427.906	3,51
13.865	Visa Inc Class A	3.609.753	2,34
13.756	Zoetis Inc Class A	2.715.022	1,76
	US-Dollar insgesamt	**106.047.139**	**68,61**
	Aktien insgesamt *	**153.603.419**	**99,37**
	Anlagen insgesamt	**153.603.419**	**99,37**

Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**153.603.419**	**99,37**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**153.603.419**	**99,37**
Sonstiges Nettovermögen	**969.876**	**0,63**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**154.573.295**	**100,00**

Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtver-mögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	153.603.419	98,95
Anlagen insgesamt	**153.603.419**	**98,95**

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %)		
	Australischer Dollar		
17.399	Brambles Ltd*	161.462	0,29
35.789	Fortescue Ltd*	708.687	1,28
5.765	National Australia Bank Ltd*	120.766	0,22
2.039	Rio Tinto Ltd*	188.745	0,34
66.677	Santos Ltd*	345.778	0,62
39.359	Telstra Group Ltd*	106.352	0,19
	Australischer Dollar insgesamt	**1.631.790**	**2,94**
	Brasilianischer Real		
49.378	Ambev SA*	138.772	0,25
8.054	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao*	24.097	0,04
41.366	Banco Bradesco SA - Preferred Shares*	144.251	0,26
13.155	Banco do Brasil SA*	149.960	0,27
15.723	BB Seguridade Participacoes SA*	109.200	0,20
	Brasilianischer Real insgesamt	**566.280**	**1,02**
	Kanadischer Dollar		
457	CGI Inc*	49.197	0,09
1.891	George Weston Ltd**	235.909	0,42
5.571	Hydro One Ltd**	167.730	0,30
2.138	iA Financial Corp Inc**	146.463	0,27
3.708	Loblaw Cos Ltd**	360.733	0,65
28.463	Manulife Financial Corp*	632.031	1,14
1.952	Metro Inc**	101.538	0,18
1.017	Nutrien Ltd*	57.576	0,10
1.854	Quebecor Inc Class B**	44.318	0,08
3.981	Toronto-Dominion Bank*	258.496	0,47
	Kanadischer Dollar insgesamt	**2.053.991**	**3,70**
	Euro		
2.486	AXA SA*	80.984	0,14
4.473	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*	40.646	0,07
3.558	Bayerische Motoren Werke AG*	396.100	0,72
856	Bayerische Motoren Werke AG - Preferred Shares*	85.055	0,15
2.984	BNP Paribas SA*	206.314	0,37
672	Cie de Saint-Gobain SA*	49.483	0,09
3.906	Credit Agricole SA*	55.453	0,10
7.003	Deutsche Post AG*	346.992	0,63
1.298	Eiffage SA*	139.111	0,25

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)		
	Euro (Fortsetzung)		
20.684	Eni SpA*	350.680	0,63
888	Eurazeo SE*	70.480	0,13
30.629	Iberdrola SA*	401.613	0,73
3.460	Industria de Diseno Textil SA*	150.705	0,27
2.021	Randstad NV*	126.627	0,23
6.513	Redeia Corp SA*	107.271	0,19
9.946	Repsol SA*	147.773	0,27
1.728	Sanofi SA*	171.337	0,31
1.017	SAP SE*	156.696	0,28
2.300	STMicroelectronics NV*	114.954	0,21
22.383	Telefonica SA*	87.380	0,16
11.254	TotalEnergies SE*	765.795	1,38
14.194	UniCredit SpA*	385.165	0,69
1.749	Vinci SA*	219.672	0,40
552	Wendel SE*	49.178	0,09
613	Wolters Kluwer NV*	87.149	0,16
	Euro insgesamt	**4.792.613**	**8,65**
	Hongkong-Dollar		
188.000	Agricultural Bank of China Ltd - H Shares*	72.469	0,13
33.900	Alibaba Group Holding Ltd*	328.209	0,59
24.000	Aluminum Corp of China Ltd - H Shares*	11.987	0,02
1.150	Baidu Inc Class A*	17.099	0,03
172.000	Bank of China Ltd - H Shares*	65.641	0,12
384.000	China Construction Bank Corp - H Shares*	228.672	0,41
7.000	China Life Insurance Co Ltd - H Shares*	9.072	0,02
16.000	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares*	55.734	0,10
4.500	China Overseas Land & Investment Ltd*	7.930	0,01
14.000	China Resources Land Ltd*	50.201	0,09
37.000	CITIC Ltd*	36.959	0,07
14.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd*	13.017	0,02
313.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd - H Shares*	153.122	0,28
1.250	JD.com Inc Class A*	18.009	0,03
5.500	Longfor Group Holdings Ltd*	8.804	0,02
4.110	Meituan Class B*	43.108	0,08
6.900	NetEase Inc*	124.241	0,22
27.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares*	124.495	0,23
36.800	Sinopharm Group Co Ltd - H Shares*	96.376	0,17
3.500	Sun Hung Kai Properties Ltd*	37.853	0,07

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)		
	Hongkong-Dollar (Fortsetzung)		
3.300	Tencent Holdings Ltd*	124.079	0,22
5.000	Wuxi Biologics Cayman Inc*	18.954	0,04
	Hongkong-Dollar insgesamt	**1.646.031**	**2,97**
	Indonesische Rupiah		
131.831	Bank Central Asia Tbk PT*	80.484	0,15
438.353	Telkom Indonesia Persero Tbk PT*	112.457	0,20
	Indonesische Rupiah insgesamt	**192.941**	**0,35**
	Japanischer Yen		
5.900	Astellas Pharma Inc*	70.559	0,13
2.500	Bridgestone Corp*	103.561	0,19
12.900	Canon Inc*	331.238	0,60
3.200	Hitachi Ltd*	230.841	0,42
53.200	Honda Motor Co Ltd*	553.208	1,00
10.600	KDDI Corp*	337.293	0,61
15.600	Mitsubishi Chemical Group Corp*	95.605	0,17
1.400	Mitsui & Co Ltd*	52.612	0,09
5.200	Mizuho Financial Group Inc*	88.984	0,16
1.300	MS&AD Insurance Group Holdings Inc*	51.140	0,09
1.100	Nippon Express Holdings Inc*	62.529	0,11
80.500	Nippon Telegraph & Telephone Corp*	98.384	0,17
2.300	Nitto Denko Corp*	172.117	0,31
1.900	Shionogi & Co Ltd*	91.617	0,17
3.300	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc*	161.044	0,29
4.400	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc*	84.455	0,15
10.900	Takeda Pharmaceutical Co Ltd*	313.439	0,56
9.700	Tokio Marine Holdings Inc*	242.810	0,44
	Japanischer Yen insgesamt	**3.141.436**	**5,66**
	Mexikanischer Peso		
8.779	Fomento Economico Mexicano SAB de CV*	114.807	0,21
20.533	Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O*	207.458	0,37
13.487	Grupo Mexico SAB de CV*	75.166	0,14
	Mexikanischer Peso insgesamt	**397.431**	**0,72**
	Neuer taiwanesischer Dollar		
51.000	ASE Technology Holding Co Ltd*	224.336	0,40
79.650	China Steel Corp*	70.072	0,13
32.492	Chunghwa Telecom Co Ltd*	127.044	0,23
11.000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd*	37.455	0,07

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)		
	Neuer taiwanesischer Dollar (Fortsetzung)		
6.624	MediaTek Inc*	219.070	0,40
9.559	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd*	184.698	0,33
30.000	Uni-President Enterprises Corp*	72.824	0,13
62.000	United Microelectronics Corp*	106.261	0,19
	Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt	**1.041.760**	**1,88**
	Neuseeländischer Dollar		
33.835	Spark New Zealand Ltd*	110.969	0,20
	Neuseeländischer Dollar insgesamt	**110.969**	**0,20**
	Norwegische Krone		
11.482	Equinor ASA*	364.222	0,66
	Norwegische Krone insgesamt	**364.222**	**0,66**
	Britisches Pfund		
3.904	3i Group Plc*	120.489	0,22
146.481	Barclays Plc*	287.159	0,52
63.723	BP Plc*	378.673	0,68
1.692	Burberry Group Plc*	30.542	0,06
6.016	HSBC Holdings Plc*	48.738	0,09
432.300	Lloyds Banking Group Plc*	262.928	0,47
43.741	NatWest Group Plc*	122.340	0,22
2.264	Next Plc*	234.297	0,42
3.482	RELX Plc*	138.048	0,25
28.921	Shell Plc*	948.073	1,71
1.821	Unilever Plc*	88.214	0,16
	Britisches Pfund insgesamt	**2.659.501**	**4,80**
	Singapur-Dollar		
11.500	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	113.335	0,20
17.200	Singapore Airlines Ltd*	85.537	0,15
17.400	Wilmar International Ltd*	47.091	0,09
	Singapur-Dollar insgesamt	**245.963**	**0,44**
	Südafrikanischer Rand		
9.603	FirstRand Ltd*	38.601	0,07
8.644	Impala Platinum Holdings Ltd*	43.141	0,08
15.945	Sanlam Ltd*	63.475	0,11
5.341	Sasol Ltd*	54.115	0,10
	Südafrikanischer Rand insgesamt	**199.332**	**0,36**

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)		
	Südkoreanischer Won		
134	Hyundai Mobis Co Ltd*	24.550	0,04
1.183	Hyundai Motor Co*	186.092	0,34
2.570	KB Financial Group Inc*	107.225	0,19
1.438	Kia Corp*	111.205	0,20
700	LG Corp*	46.518	0,08
5.262	Samsung Electronics Co Ltd*	319.387	0,58
	Südkoreanischer Won insgesamt	**794.977**	**1,43**
	Schwedische Krone		
10.773	Nordea Bank Abp*	133.986	0,24
	Schwedische Krone insgesamt	**133.986**	**0,24**
	Schweizer Franken		
3.474	ABB Ltd*	153.960	0,28
882	Kuehne + Nagel International AG*	303.693	0,55
3.553	Novartis AG*	358.276	0,64
722	Roche Holding AG*	209.742	0,38
196	Swiss Re AG*	22.021	0,04
144	Swisscom AG*	86.573	0,16
1.851	UBS Group AG*	57.400	0,10
	Schweizer Franken insgesamt	**1.191.665**	**2,15**
	US-Dollar		
5.205	AbbVie Inc*	806.619	1,45
1.185	Accenture Plc Class A*	415.828	0,75
4.993	Aflac Inc*	411.922	0,75
6.766	Alphabet Inc Class A*	945.143	1,70
4.112	Alphabet Inc Class C*	579.504	1,05
1.315	American Express Co*	246.352	0,44
1.695	Ameriprise Financial Inc*	643.812	1,16
1.136	Amgen Inc*	327.191	0,59
621	Apollo Global Management Inc*	57.871	0,10
5.877	Apple Inc*	1.131.499	2,04
3.893	Applied Materials Inc*	630.939	1,14
4.666	Bank of America Corp*	157.104	0,28
2.451	Bank of New York Mellon Corp*	127.574	0,23
645	Broadcom Inc*	719.981	1,30
1.955	Cardinal Health Inc*	197.064	0,36
2.929	Caterpillar Inc*	866.017	1,56
1.386	Cencora Inc*	284.657	0,52
21	Chipotle Mexican Grill Inc Class A*	48.026	0,09

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
1.607	Chubb Ltd*	363.182	0,65
2.180	Cigna Corp*	652.801	1,18
73	Cintas Corp*	43.994	0,08
14.791	Cisco Systems Inc*	747.241	1,35
10.415	Citigroup Inc*	535.748	0,97
5.009	Coca-Cola Europacific Partners Plc*	334.301	0,60
1.990	Cognizant Technology Solutions Corp Class A*	150.305	0,27
622	Colgate-Palmolive Co*	49.580	0,09
21.255	Comcast Corp Class A*	932.032	1,68
19.406	CSX Corp*	672.806	1,21
1.292	DR Horton Inc*	196.358	0,35
4.812	Edison International*	344.010	0,62
1.505	Electronic Arts Inc*	205.899	0,37
528	Elevance Health Inc*	248.984	0,45
100	Eli Lilly & Co*	58.292	0,11
255	Everest Group Ltd*	90.163	0,16
3.360	Expeditors International of Washington Inc*	427.392	0,77
3.171	Ferguson Plc*	612.225	1,10
373	Fiserv Inc*	49.549	0,09
7.458	Fox Corp Class B*	206.214	0,37
1.166	General Mills Inc*	75.953	0,14
9.255	Gilead Sciences Inc*	749.747	1,35
165	Goldman Sachs Group Inc*	63.652	0,11
6.896	Halliburton Co*	249.291	0,45
6.949	Hartford Financial Services Group Inc*	558.561	1,01
1.463	HCA Healthcare Inc*	396.005	0,71
1.153	Hewlett Packard Enterprise Co*	19.578	0,03
1.362	Home Depot Inc*	472.001	0,85
769	Humana Inc*	352.056	0,63
947	Illinois Tool Works Inc*	248.057	0,45
2.927	International Business Machines Corp*	478.711	0,86
3.751	Johnson & Johnson*	587.932	1,06
2.314	JPMorgan Chase & Co*	393.611	0,71
1.314	Kimberly-Clark Corp*	159.664	0,29
839	KLA Corp*	487.711	0,88
5.039	Kroger Co*	230.333	0,41
417	Lam Research Corp*	326.619	0,59
128	Linde Plc*	52.571	0,09
319	Lockheed Martin Corp*	144.583	0,26
1.360	Loews Corp*	94.642	0,17
1.403	LyondellBasell Industries NV Class A*	133.397	0,24

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
456	Marriott International Inc Class A*	102.833	0,19
631	Marsh & McLennan Cos Inc*	119.555	0,22
553	Mastercard Inc Class A*	235.860	0,43
1.496	McDonald's Corp*	443.579	0,80
202	McKesson Corp*	93.522	0,17
7.461	Merck & Co Inc*	813.398	1,47
329	Meta Platforms Inc Class A*	116.453	0,21
2.637	Microchip Technology Inc*	237.805	0,43
1.632	Microsoft Corp*	613.697	1,10
3.051	Molson Coors Beverage Co Class B*	186.752	0,34
2.772	Morgan Stanley*	258.489	0,47
275	Motorola Solutions Inc*	86.100	0,16
3.157	Nucor Corp*	549.445	0,99
40	NVR Inc*	280.018	0,51
1.007	NXP Semiconductors NV*	231.288	0,41
9.549	Occidental Petroleum Corp*	570.171	1,03
2.242	Owens Corning*	332.332	0,60
568	PACCAR Inc*	55.465	0,10
1.253	Packaging Corp of America*	204.126	0,37
773	Parker-Hannifin Corp*	356.121	0,64
556	PDD Holdings Inc ADR*	81.348	0,14
845	PepsiCo Inc*	143.515	0,26
2.590	PNC Financial Services Group Inc*	401.061	0,72
2.195	Procter & Gamble Co*	321.655	0,58
5.007	PulteGroup Inc*	516.823	0,93
709	QUALCOMM Inc*	102.543	0,18
681	Reliance Steel & Aluminum Co*	190.462	0,34
827	Schlumberger Ltd*	43.037	0,08
802	SEI Investments Co*	50.967	0,09
693	Skyworks Solutions Inc*	77.907	0,14
668	Snap-on Inc*	192.945	0,35
1.082	Starbucks Corp*	103.883	0,19
851	Steel Dynamics Inc*	100.503	0,18
1.416	TE Connectivity Ltd*	198.948	0,36
1.238	Texas Instruments Inc*	211.030	0,38
3.730	TJX Cos Inc*	349.911	0,63
266	Trane Technologies Plc*	64.878	0,12
1.626	Travelers Cos Inc*	309.737	0,56
275	Union Pacific Corp*	67.546	0,12
258	United Rentals Inc*	147.942	0,27
626	UnitedHealth Group Inc*	329.570	0,59

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 97,01 % (31. Dezember 2022: 97,79 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
6.340	Verizon Communications Inc*	239.018	0,43
755	Visa Inc Class A*	196.564	0,35
269	Walmart Inc*	42.408	0,08
1.064	Wells Fargo & Co*	52.370	0,09
2.821	Williams Cos Inc*	98.255	0,18
148	WW Grainger Inc*	122.646	0,22
2.276	Yum China Holdings Inc*	96.571	0,17
844	Yum! Brands Inc*	110.277	0,20
	US-Dollar insgesamt	**32.644.183**	**58,84**
	Aktien insgesamt	**53.809.071**	**97,01**
	Immobilienaktiengesellschaften 2,02 % (31. Dezember 2022: 1,57 %)		
	Australischer Dollar		
16.548	Stockland	50.247	0,09
	Australischer Dollar insgesamt	**50.247**	**0,09**
	Euro		
2.396	Klepierre SA	65.321	0,12
	Euro insgesamt	**65.321**	**0,12**
	Britisches Pfund		
2.425	Land Securities Group Plc	21.788	0,04
	Britisches Pfund insgesamt	**21.788**	**0,04**
	US-Dollar		
213	Essex Property Trust Inc	52.811	0,10
8.055	Host Hotels & Resorts Inc	156.831	0,28
1.699	Regency Centers Corp	113.833	0,21
4.596	Simon Property Group Inc	655.573	1,18
	US-Dollar insgesamt	**979.048**	**1,77**
	Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *	**1.116.404**	**2,02**
	Anlagen insgesamt	**54.925.475**	**99,03**

Global Sustainable Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,12 % (31. Dezember 2022: 0,26 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
23.730 €	25.719 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	512	0,00
841.176 €	897.010 US$	18.01.2024	UBS AG	9	32.773	0,06
823.668 €	877.268 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	15	33.163	0,06
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**66.448**	**0,12**

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**54.991.923**	**99,15**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,19 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
5.120 €	5.673 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(14)	(0,00)
14.290 US$	13.339 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(454)	(0,00)
600.291 US$	563.223 €	18.01.2024	UBS AG	2	(22.261)	(0,04)
633.853 US$	595.312 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	11	(24.168)	(0,04)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(46.897)**	**(0,08)**

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(46.897)**	**(0,08)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**54.945.026**	**99,07**
Sonstiges Nettovermögen	**520.868**	**0,93**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**55.465.894**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	53.868.784	96,81
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.056.691	1,90
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	19.551	0,04
Anlagen insgesamt		**54.945.026**	**98,75**

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 0,49 % (31. Dezember 2022: 0,95 %)				
	US-Dollar				
1.000.000	AB BSL CLO 3 Ltd Series 2021-3X Class E	12,53 %	20.10.2034	962.016	0,04
4.000.000	AB BSL CLO 4 Ltd Series 2023-4X Class D	10,82 %	20.04.2036	4.019.966	0,18
1.400.000	Aimco CDO Series 2020-12X Class ER	11,42 %	17.01.2032	1.371.150	0,06
2.000.000	Ocean Trails CLO XIV Ltd Series 2023-14X Class D	11,14 %	20.01.2035	1.988.987	0,09
2.500.000	Trinitas CLO XXI Ltd Series 2022-21X Class D	11,64 %	20.01.2036	2.555.863	0,12
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **			**10.897.982**	**0,49**
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %)				
	US-Dollar				
1.995.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	3,50 %	15.02.2029	1.841.529	0,08
4.105.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	3,88 %	15.01.2028	3.881.065	0,17
2.740.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	4,00 %	15.10.2030	2.460.873	0,11
4.235.000	180 Medical Inc**	3,88 %	15.10.2029	3.819.229	0,17
1.690.000	Acushnet Co**	7,38 %	15.10.2028	1.764.216	0,08
2.000.000	Adient Global Holdings Ltd**	8,25 %	15.04.2031	2.119.388	0,09
2.730.000	ADT Security Corp**	4,13 %	01.08.2029	2.515.286	0,11
2.055.000	ADT Security Corp**	4,88 %	15.07.2032	1.903.125	0,08
2.680.000	Advanced Drainage Systems Inc**	6,38 %	15.06.2030	2.701.798	0,12
2.334.000	AerCap Global Aviation Trust*	6,50 %	15.06.2045	2.340.278	0,10
6.620.000	Ahead DB Holdings LLC**	6,63 %	01.05.2028	5.774.328	0,26
6.335.000	Ahlstrom Holding 3 Oy*	4,88 %	04.02.2028	5.562.157	0,25
3.410.000	Air Canada**	3,88 %	15.08.2026	3.260.028	0,14
380.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	3,25 %	15.03.2026	358.770	0,02
2.820.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	3,50 %	15.03.2029	2.563.809	0,11
6.935.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	4,88 %	15.02.2030	6.646.620	0,30
990.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	5,88 %	15.02.2028	991.283	0,04
7.245.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	6,50 %	15.02.2028	7.336.091	0,33
10.023.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.10.2027	9.997.942	0,44
4.560.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.04.2028	4.667.867	0,21
2.740.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	7,00 %	15.01.2031	2.892.043	0,13
7.145.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**	6,00 %	01.06.2029	5.832.457	0,26
3.445.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**	6,63 %	15.07.2026	3.430.148	0,15
3.165.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl**	4,63 %	01.06.2028	2.880.898	0,13
5.230.000	Allwyn Entertainment Financing UK Plc**	7,88 %	30.04.2029	5.347.675	0,24
1.295.000	Ally Financial Inc*	5,75 %	20.11.2025	1.287.920	0,06
2.085.000	Ally Financial Inc*	5,80 %	01.05.2025	2.088.612	0,09
2.070.000	Altice Financing SA**	5,00 %	15.01.2028	1.878.031	0,08
4.705.000	Altice Financing SA**	5,75 %	15.08.2029	4.181.538	0,19
8.810.000	Altice France Holding SA**	6,00 %	15.02.2028	4.239.410	0,19

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
8.280.000	Altice France SA*	5,50 %	15.01.2028	6.825.743	0,30
4.320.000	Altice France SA**	5,50 %	15.10.2029	3.392.861	0,15
2.540.000	American Airlines Inc**	7,25 %	15.02.2028	2.571.356	0,11
11.808.334	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50 %	20.04.2026	11.731.833	0,52
15.240.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,75 %	20.04.2029	14.872.829	0,66
2.675.000	Amkor Technology Inc**	6,63 %	15.09.2027	2.710.778	0,12
1.301.000	Amsted Industries Inc**	5,63 %	01.07.2027	1.297.634	0,06
2.605.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,38 %	15.06.2029	2.507.452	0,11
3.675.000	Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp**	5,75 %	01.03.2027	3.648.767	0,16
2.985.000	APi Group DE Inc**	4,13 %	15.07.2029	2.736.831	0,12
885.000	APi Group DE Inc**	4,75 %	15.10.2029	832.289	0,04
9.655.000	APX Group Inc**	5,75 %	15.07.2029	9.013.316	0,40
605.000	APX Group Inc**	6,75 %	15.02.2027	604.341	0,03
4.790.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	4,00 %	01.09.2029	4.060.658	0,18
1.430.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	6,00 %	15.06.2027	1.425.771	0,06
5.735.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	5,25 %	15.08.2027	4.462.058	0,20
4.095.000	Arsenal AIC Parent LLC**	8,00 %	01.10.2030	4.277.678	0,19
2.690.000	Asbury Automotive Group Inc**	4,63 %	15.11.2029	2.492.879	0,11
9.455.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	5,88 %	30.06.2029	8.806.654	0,39
3.430.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	7,00 %	01.11.2026	3.456.905	0,15
5.185.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	8,25 %	31.12.2028	5.221.196	0,23
6.309.000	ASGN Inc**	4,63 %	15.05.2028	5.997.506	0,27
4.832.000	Ashland Inc**	3,38 %	01.09.2031	4.173.509	0,19
5.024.000	AssuredPartners Inc**	5,63 %	15.01.2029	4.695.723	0,21
2.150.000	AssuredPartners Inc**	7,00 %	15.08.2025	2.155.930	0,10
10.210.000	AthenaHealth Group Inc**	6,50 %	15.02.2030	9.275.913	0,41
1.174.000	ATI Inc*	4,88 %	01.10.2029	1.095.830	0,05
2.405.000	ATI Inc*	5,88 %	01.12.2027	2.372.926	0,11
3.295.000	ATI Inc*	7,25 %	15.08.2030	3.432.143	0,15
2.870.000	ATS Corp**	4,13 %	15.12.2028	2.641.636	0,12
6.690.000	Avient Corp**	7,13 %	01.08.2030	6.963.614	0,31
3.525.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	8,00 %	15.02.2031	3.523.184	0,16
5.470.000	Avolon Holdings Funding Ltd**	6,38 %	04.05.2028	5.582.358	0,25
3.460.000	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV**	7,25 %	15.02.2031	3.632.941	0,16
400.000	Ball Corp*	5,25 %	01.07.2025	399.766	0,02
2.855.000	Ball Corp*	6,00 %	15.06.2029	2.919.018	0,13
415.000	Ball Corp**	6,88 %	15.03.2028	431.420	0,02
5.110.000	Banijay Entertainment SASU**	8,13 %	01.05.2029	5.265.932	0,23
3.230.000	Bank of New York Mellon Corp**	3,70 %	29.12.2049	3.037.686	0,14

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
5.900.000	Bath & Body Works Inc**	6,63 %	01.10.2030	6.033.883	0,27
3.235.000	Bausch & Lomb Escrow Corp**	8,38 %	01.10.2028	3.416.775	0,15
3.150.000	Bausch Health Cos Inc**	5,50 %	01.11.2025	2.884.439	0,13
1.015.000	Bausch Health Cos Inc**	5,75 %	15.08.2027	655.807	0,03
1.705.000	Bausch Health Cos Inc**	6,13 %	01.02.2027	1.152.682	0,05
1.660.000	Bausch Health Cos Inc**	9,00 %	15.12.2025	1.552.897	0,07
5.980.000	BCPE Empire Holdings Inc**	7,63 %	01.05.2027	5.772.500	0,26
4.550.000	Beacon Roofing Supply Inc**	6,50 %	01.08.2030	4.655.728	0,21
5.580.000	Benteler International AG**	10,50 %	15.05.2028	5.882.576	0,26
3.435.000	Berry Global Inc**	5,63 %	15.07.2027	3.412.829	0,15
2.600.000	Blackstone Mortgage Trust Inc**	3,75 %	15.01.2027	2.314.851	0,10
1.665.000	Bombardier Inc**	6,00 %	15.02.2028	1.624.175	0,07
3.007.000	Bombardier Inc**	7,88 %	15.04.2027	3.010.371	0,13
1.545.000	Bombardier Inc**	8,75 %	15.11.2030	1.646.897	0,07
3.515.000	Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**	10,00 %	15.11.2028	3.673.175	0,16
3.380.000	Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**	10,38 %	15.11.2030	3.498.300	0,16
2.690.000	BroadStreet Partners Inc**	5,88 %	15.04.2029	2.513.224	0,11
3.610.000	Buckeye Partners LP**	4,50 %	01.03.2028	3.404.389	0,15
4.851.000	Buckeye Partners LP**	5,85 %	15.11.2043	3.937.363	0,18
1.980.000	Builders FirstSource Inc**	5,00 %	01.03.2030	1.914.124	0,09
5.350.000	Builders FirstSource Inc**	6,38 %	15.06.2032	5.468.957	0,24
5.250.000	Cable One Inc**	4,00 %	15.11.2030	4.257.137	0,19
3.750.000	Caesars Entertainment Inc**	6,25 %	01.07.2025	3.763.027	0,17
4.540.000	Caesars Entertainment Inc**	8,13 %	01.07.2027	4.657.059	0,21
6.640.000	Calderys Financing LLC**	11,25 %	01.06.2028	6.962.973	0,31
2.035.000	Callon Petroleum Co**	7,50 %	15.06.2030	2.054.497	0,09
2.299.000	Calpine Corp**	4,63 %	01.02.2029	2.137.602	0,10
4.837.000	Calpine Corp**	5,00 %	01.02.2031	4.440.491	0,20
85.000	Calpine Corp**	5,13 %	15.03.2028	81.549	0,00
1.900.000	Calpine Corp**	5,25 %	01.06.2026	1.875.947	0,08
11.085.000	Camelot Return Merger Sub Inc**	8,75 %	01.08.2028	11.265.953	0,50
1.165.000	Carnival Corp**	5,75 %	01.03.2027	1.137.254	0,05
2.635.000	Carnival Corp**	7,00 %	15.08.2029	2.752.903	0,12
6.645.000	Carnival Corp**	7,63 %	01.03.2026	6.769.301	0,30
2.775.000	Carnival Corp**	9,88 %	01.08.2027	2.915.074	0,13
12.730.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd**	10,38 %	01.05.2028	13.865.440	0,62
2.180.000	Carnival Plc*	7,88 %	01.06.2027	2.283.583	0,10
28.000	Carpenter Technology Corp*	6,38 %	15.07.2028	27.928	0,00
4.375.000	Carpenter Technology Corp*	7,63 %	15.03.2030	4.517.541	0,20
5.285.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	3,13 %	15.02.2029	4.630.981	0,21

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.345.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	3,50 %	01.04.2030	1.171.533	0,05
3.290.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,25 %	01.02.2031	2.879.590	0,13
3.160.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,25 %	15.01.2034	2.572.136	0,11
2.015.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,50 %	15.08.2030	1.819.181	0,08
5.000.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,50 %	01.05.2032	4.288.947	0,19
5.545.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,75 %	01.03.2030	5.074.783	0,23
2.330.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,75 %	01.02.2032	2.057.623	0,09
13.810.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,00 %	01.02.2028	13.223.940	0,59
1.120.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,13 %	01.05.2027	1.082.810	0,05
4.375.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	6,38 %	01.09.2029	4.320.281	0,19
1.900.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	7,38 %	01.03.2031	1.951.279	0,09
2.580.000	Cedar Fair LP**	5,25 %	15.07.2029	2.436.965	0,11
945.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	5,50 %	01.05.2025	940.840	0,04
3.315.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	6,50 %	01.10.2028	3.294.835	0,15
1.045.000	Central Parent Inc/CDK Global Inc**	7,25 %	15.06.2029	1.066.520	0,05
1.185.000	Central Parent LLC/CDK Global II LLC/CDK Financing Co Inc**	8,00 %	15.06.2029	1.237.768	0,06
10.210.000	Chart Industries Inc**	7,50 %	01.01.2030	10.684.734	0,47
2.720.000	Chesapeake Energy Corp**	6,75 %	15.04.2029	2.748.215	0,12
5.345.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,25 %	15.05.2030	4.477.648	0,20
3.045.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,63 %	15.03.2027	2.833.198	0,13
1.555.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,00 %	15.01.2029	1.401.475	0,06
2.695.000	CHS/Community Health Systems Inc**	10,88 %	15.01.2032	2.819.994	0,13
2.395.000	Churchill Downs Inc**	4,75 %	15.01.2028	2.296.855	0,10
1.215.000	Churchill Downs Inc**	5,50 %	01.04.2027	1.203.184	0,05
8.590.000	Churchill Downs Inc**	6,75 %	01.05.2031	8.729.033	0,39
3.160.000	Ciena Corp**	4,00 %	31.01.2030	2.881.462	0,13
5.520.000	Civitas Resources Inc**	8,38 %	01.07.2028	5.769.476	0,26
12.165.000	Civitas Resources Inc**	8,63 %	01.11.2030	12.913.963	0,57
5.360.000	Civitas Resources Inc**	8,75 %	01.07.2031	5.712.672	0,25
1.115.000	Clearway Energy Operating LLC**	3,75 %	15.01.2032	972.676	0,04
3.865.000	CommScope Inc**	4,75 %	01.09.2029	2.598.616	0,12
3.465.000	CommScope Inc**	8,25 %	01.03.2027	1.832.673	0,08
7.487.000	CommScope Technologies LLC**	5,00 %	15.03.2027	3.123.464	0,14
7.875.000	Comstock Resources Inc**	5,88 %	15.01.2030	6.840.583	0,30
8.169.000	Comstock Resources Inc**	6,75 %	01.03.2029	7.480.943	0,33
2.620.000	Consensus Cloud Solutions Inc**	6,50 %	15.10.2028	2.379.185	0,11
4.070.000	Cornerstone Building Brands Inc**	6,13 %	15.01.2029	3.341.572	0,15
6.220.000	Coty Inc**	5,00 %	15.04.2026	6.125.624	0,27
2.195.000	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC**	4,75 %	15.01.2029	2.095.424	0,09
5.970.000	Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC**	6,63 %	15.07.2030	6.136.773	0,27

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
11.190.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	5,50 %	15.06.2031	10.619.415	0,47
3.420.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	7,50 %	15.12.2033	3.548.377	0,16
1.770.000	Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp VI**	4,75 %	01.02.2026	1.754.303	0,08
6.330.000	CSC Holdings LLC**	4,13 %	01.12.2030	4.822.954	0,21
4.795.000	CSC Holdings LLC**	4,63 %	01.12.2030	2.893.161	0,13
4.305.000	CSC Holdings LLC**	5,00 %	15.11.2031	2.609.347	0,12
5.290.000	CSC Holdings LLC**	5,25 %	01.06.2024	5.182.301	0,23
3.905.000	CSC Holdings LLC**	5,38 %	01.02.2028	3.453.087	0,15
14.630.000	CSC Holdings LLC**	5,75 %	15.01.2030	9.122.390	0,41
2.525.000	CSC Holdings LLC**	11,25 %	15.05.2028	2.603.439	0,12
6.550.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC**	8,88 %	01.09.2031	6.946.439	0,31
6.695.000	Dana Inc*	4,50 %	15.02.2032	5.832.648	0,26
3.390.000	Dana Inc*	5,38 %	15.11.2027	3.369.660	0,15
720.000	Dana Inc*	5,63 %	15.06.2028	710.517	0,03
1.095.000	Darling Ingredients Inc**	6,00 %	15.06.2030	1.096.544	0,05
1.470.000	DaVita Inc**	3,75 %	15.02.2031	1.209.634	0,05
1.755.000	DaVita Inc**	4,63 %	01.06.2030	1.533.650	0,07
5.325.000	Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**	8,00 %	01.02.2028	5.277.954	0,23
3.655.000	Diamond Foreign Asset Co/Diamond Finance LLC**	8,50 %	01.10.2030	3.740.699	0,17
6.175.000	Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co**	5,38 %	15.08.2026	316.469	0,01
7.170.000	DISH DBS Corp**	5,13 %	01.06.2029	3.702.767	0,16
2.665.000	DISH DBS Corp**	5,25 %	01.12.2026	2.288.236	0,10
1.865.000	DISH DBS Corp**	7,75 %	01.07.2026	1.300.912	0,06
5.240.000	DISH Network Corp**	3,38 %	15.08.2026	2.803.400	0,12
3.520.000	DISH Network Corp**	11,75 %	15.11.2027	3.677.245	0,16
8.120.000	DT Midstream Inc**	4,13 %	15.06.2029	7.479.847	0,33
4.820.000	Emerald Debt Merger Sub LLC**	6,63 %	15.12.2030	4.929.028	0,22
2.538.000	Encompass Health Corp*	4,50 %	01.02.2028	2.430.640	0,11
2.340.000	Encompass Health Corp*	4,63 %	01.04.2031	2.155.991	0,10
9.980.000	Energizer Holdings Inc**	6,50 %	31.12.2027	9.990.289	0,44
515.000	Energy Transfer LP*	5,75 %	01.04.2025	515.528	0,02
4.974.000	Energy Transfer LP**	6,00 %	01.02.2029	5.021.943	0,22
525.000	Energy Transfer LP**	7,38 %	01.02.2031	552.069	0,02
2.055.000	EnLink Midstream LLC**	6,50 %	01.09.2030	2.100.438	0,09
2.880.000	EPR Properties*	3,75 %	15.08.2029	2.536.499	0,11
3.590.000	EQM Midstream Partners LP*	4,13 %	01.12.2026	3.470.629	0,15
2.570.000	EQM Midstream Partners LP**	4,50 %	15.01.2029	2.430.285	0,11
1.577.000	EQM Midstream Partners LP**	6,00 %	01.07.2025	1.577.261	0,07
3.580.000	EQM Midstream Partners LP**	6,50 %	01.07.2027	3.647.508	0,16
1.630.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2027	1.680.566	0,07

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
2.310.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2030	2.485.927	0,11
13.445.000	EquipmentShare.com Inc**	9,00 %	15.05.2028	13.849.694	0,62
4.689.000	Everi Holdings Inc**	5,00 %	15.07.2029	4.262.095	0,19
1.745.000	Fair Isaac Corp**	5,25 %	15.05.2026	1.734.111	0,08
1.365.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	01.03.2026	1.223.648	0,05
1.300.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	15.10.2027	1.106.625	0,05
913.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50 %	01.04.2025	871.372	0,04
3.650.000	First Quantum Minerals Ltd**	8,63 %	01.06.2031	3.097.937	0,14
2.780.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	4,38 %	01.04.2031	2.546.741	0,11
1.145.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	6,13 %	15.04.2032	1.154.840	0,05
3.260.000	Foot Locker Inc**	4,00 %	01.10.2029	2.701.741	0,12
2.380.000	Ford Motor Co*	6,10 %	19.08.2032	2.400.299	0,11
1.975.000	Ford Motor Co*	9,63 %	22.04.2030	2.329.183	0,10
1.370.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,63 %	17.06.2031	1.182.116	0,05
2.480.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,13 %	17.08.2027	2.349.934	0,10
2.385.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,11 %	03.05.2029	2.321.438	0,10
1.685.000	Ford Motor Credit Co LLC*	6,80 %	12.05.2028	1.761.124	0,08
1.650.000	Ford Motor Credit Co LLC*	7,20 %	10.06.2030	1.759.140	0,08
2.350.000	Ford Motor Credit Co LLC*	7,35 %	04.11.2027	2.479.798	0,11
4.055.000	Ford Motor Credit Co LLC**	8,37 %	06.03.2026	4.165.615	0,19
1.385.000	Fortrea Holdings Inc**	7,50 %	01.07.2030	1.424.088	0,06
2.925.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,00 %	01.05.2028	2.705.908	0,12
6.500.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88 %	01.11.2029	5.499.837	0,24
2.705.000	Frontier Communications Holdings LLC**	8,75 %	15.05.2030	2.784.821	0,12
2.795.000	Gap Inc**	3,63 %	01.10.2029	2.393.149	0,11
2.730.000	Garda World Security Corp**	6,00 %	01.06.2029	2.450.046	0,11
1.260.000	Garda World Security Corp**	7,75 %	15.02.2028	1.304.893	0,06
2.850.000	Gen Digital Inc**	6,75 %	30.09.2027	2.901.169	0,13
3.910.000	Gen Digital Inc**	7,13 %	30.09.2030	4.090.407	0,18
800.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	6,25 %	15.05.2026	799.809	0,04
3.160.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	7,75 %	01.02.2028	3.174.271	0,14
3.915.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,25 %	15.01.2029	4.031.824	0,18
2.650.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,88 %	15.04.2030	2.743.026	0,12
585.000	GFL Environmental Inc**	3,50 %	01.09.2028	541.158	0,02
385.000	GFL Environmental Inc**	3,75 %	01.08.2025	376.234	0,02
2.520.000	GFL Environmental Inc**	6,75 %	15.01.2031	2.599.458	0,12
4.256.232	Global Aircraft Leasing Co Ltd**	6,50 %	15.09.2024	4.005.817	0,18
8.560.000	Global Infrastructure Solutions Inc**	5,63 %	01.06.2029	7.827.275	0,35
155.000	Global Infrastructure Solutions Inc**	7,50 %	15.04.2032	143.186	0,01
4.430.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00 %	31.05.2026	4.364.566	0,19

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.125.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,25 %	30.04.2031	1.030.726	0,05
4.815.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,25 %	15.07.2031	4.374.692	0,19
6.325.000	Greystar Real Estate Partners LLC**	7,75 %	01.09.2030	6.633.976	0,29
2.465.000	GTCR AP Finance Inc**	8,00 %	15.05.2027	2.493.367	0,11
8.505.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC**	7,50 %	15.01.2031	8.992.951	0,40
4.480.000	GYP Holdings III Corp**	4,63 %	01.05.2029	4.115.769	0,18
6.695.000	Harvest Midstream I LP**	7,50 %	01.09.2028	6.662.661	0,30
2.097.000	HealthEquity Inc**	4,50 %	01.10.2029	1.949.705	0,09
2.410.000	Hertz Corp**	4,63 %	01.12.2026	2.162.890	0,10
1.470.000	Hess Midstream Operations LP**	5,50 %	15.10.2030	1.424.405	0,06
1.293.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	5,75 %	01.02.2029	1.250.092	0,06
3.285.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,00 %	15.04.2030	3.190.249	0,14
2.195.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,00 %	01.02.2031	2.123.970	0,09
2.200.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,25 %	01.11.2028	2.193.966	0,10
3.155.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	8,38 %	01.11.2033	3.347.408	0,15
5.915.000	Howard Midstream Energy Partners LLC**	6,75 %	15.01.2027	5.855.096	0,26
3.415.000	Howard Midstream Energy Partners LLC**	8,88 %	15.07.2028	3.587.966	0,16
2.935.000	HUB International Ltd**	7,00 %	01.05.2026	2.949.748	0,13
9.200.000	HUB International Ltd**	7,25 %	15.06.2030	9.723.526	0,43
6.840.000	Hudbay Minerals Inc**	4,50 %	01.04.2026	6.632.383	0,29
5.209.000	Hudbay Minerals Inc**	6,13 %	01.04.2029	5.114.268	0,23
1.435.000	IHO Verwaltungs GmbH**	4,75 %	15.09.2026	1.376.115	0,06
2.585.000	IHO Verwaltungs GmbH*	6,38 %	15.05.2029	2.539.887	0,11
3.270.000	Iliad Holding SASU**	6,50 %	15.10.2026	3.265.940	0,15
5.920.000	Iliad Holding SASU**	7,00 %	15.10.2028	5.895.219	0,26
1.330.000	Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV Inc**	9,00 %	01.07.2028	1.273.341	0,06
11.520.000	Imola Merger Corp**	4,75 %	15.05.2029	10.959.537	0,49
6.985.000	INEOS Finance Plc*	6,75 %	15.05.2028	6.867.839	0,31
2.950.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc**	9,63 %	15.03.2029	3.143.848	0,14
3.705.000	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc/Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC**	6,00 %	15.09.2028	3.460.729	0,15
3.120.000	International Game Technology Plc**	4,13 %	15.04.2026	3.034.373	0,13
610.000	International Game Technology Plc**	6,25 %	15.01.2027	619.436	0,03
2.520.000	IQVIA Inc**	5,00 %	15.05.2027	2.474.817	0,11
2.685.000	Iron Mountain Inc**	4,88 %	15.09.2029	2.545.846	0,11
2.390.000	Iron Mountain Inc**	5,00 %	15.07.2028	2.298.474	0,10
3.276.000	Iron Mountain Inc**	5,25 %	15.03.2028	3.187.130	0,14
2.205.000	Iron Mountain Inc**	5,25 %	15.07.2030	2.101.459	0,09
2.350.000	Iron Mountain Inc**	5,63 %	15.07.2032	2.230.186	0,10
9.430.000	ITT Holdings LLC**	6,50 %	01.08.2029	8.351.821	0,37
4.775.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	5,50 %	15.07.2029	4.659.017	0,21

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
2.575.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	5,88 %	15.01.2028	2.544.353	0,11
6.800.000	JELD-WEN Inc**	4,88 %	15.12.2027	6.433.140	0,29
7.430.000	JPMorgan Chase & Co**	4,60 %	29.12.2049	7.183.473	0,32
6.990.000	KB Home**	7,25 %	15.07.2030	7.244.177	0,32
8.490.000	Kinetik Holdings LP**	5,88 %	15.06.2030	8.340.338	0,37
5.780.000	Knife River Corp**	7,75 %	01.05.2031	6.158.503	0,27
2.600.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2027	2.908.929	0,13
2.910.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2029	3.335.299	0,15
6.560.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25 %	01.07.2029	5.722.295	0,25
4.630.000	Legacy LifePoint Health LLC**	4,38 %	15.02.2027	4.279.597	0,19
6.775.000	Level 3 Financing Inc**	3,75 %	15.07.2029	3.345.102	0,15
3.015.000	Level 3 Financing Inc**	3,88 %	15.11.2029	2.890.589	0,13
6.371.000	Level 3 Financing Inc**	4,63 %	15.09.2027	3.850.448	0,17
4.789.000	Level 3 Financing Inc**	10,50 %	15.05.2030	4.575.286	0,20
2.570.000	LifePoint Health Inc**	9,88 %	15.08.2030	2.600.431	0,12
4.470.000	Light & Wonder International Inc**	7,00 %	15.05.2028	4.519.063	0,20
4.140.000	Light & Wonder International Inc**	7,25 %	15.11.2029	4.243.045	0,19
3.860.000	Light & Wonder International Inc**	7,50 %	01.09.2031	4.028.802	0,18
3.120.000	Lindblad Expeditions Holdings Inc**	9,00 %	15.05.2028	3.240.011	0,14
100.000	Lindblad Expeditions LLC**	6,75 %	15.02.2027	99.585	0,00
1.410.000	Lions Gate Capital Holdings LLC**	5,50 %	15.04.2029	1.056.196	0,05
1.025.000	Live Nation Entertainment Inc**	3,75 %	15.01.2028	958.470	0,04
2.780.000	Live Nation Entertainment Inc**	6,50 %	15.05.2027	2.830.449	0,13
1.510.000	LPL Holdings Inc**	4,00 %	15.03.2029	1.399.100	0,06
1.245.000	LPL Holdings Inc**	4,63 %	15.11.2027	1.203.595	0,05
2.040.000	Lumen Technologies Inc**	4,00 %	15.02.2027	1.318.472	0,06
3.915.000	Macy's Retail Holdings LLC*	4,50 %	15.12.2034	3.177.949	0,14
2.505.000	Macy's Retail Holdings LLC*	5,13 %	15.01.2042	1.957.470	0,09
2.535.000	Macy's Retail Holdings LLC**	5,88 %	01.04.2029	2.436.442	0,11
1.880.000	Macy's Retail Holdings LLC**	5,88 %	15.03.2030	1.788.698	0,08
5.680.000	Madison IAQ LLC**	5,88 %	30.06.2029	5.011.542	0,22
4.421.000	Manitowoc Co Inc**	9,00 %	01.04.2026	4.453.846	0,20
1.605.000	Masonite International Corp**	3,50 %	15.02.2030	1.393.180	0,06
2.725.000	Masonite International Corp**	5,38 %	01.02.2028	2.619.706	0,12
1.225.000	Match Group Holdings II LLC**	4,13 %	01.08.2030	1.112.828	0,05
3.345.000	Match Group Holdings II LLC**	4,63 %	01.06.2028	3.205.614	0,14
4.624.000	Match Group Holdings II LLC**	5,63 %	15.02.2029	4.494.967	0,20
2.605.000	Mattamy Group Corp**	4,63 %	01.03.2030	2.416.971	0,11
1.210.000	Mattamy Group Corp**	5,25 %	15.12.2027	1.177.784	0,05
5.975.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,88 %	15.08.2026	6.086.021	0,27

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
11.120.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	9,25 %	15.04.2027	10.926.956	0,49
5.035.000	McAfee Corp**	7,38 %	15.02.2030	4.604.943	0,20
2.664.000	McGraw-Hill Education Inc**	5,75 %	01.08.2028	2.571.479	0,11
4.825.000	McGraw-Hill Education Inc**	8,00 %	01.08.2029	4.491.882	0,20
5.365.000	Medline Borrower LP**	3,88 %	01.04.2029	4.857.225	0,22
6.425.000	Medline Borrower LP**	5,25 %	01.10.2029	6.064.663	0,27
1.375.000	Meritage Homes Corp*	5,13 %	06.06.2027	1.356.413	0,06
1.330.000	Merlin Entertainments Ltd**	5,75 %	15.06.2026	1.317.418	0,06
3.715.000	Midcontinent Communications/Midcontinent Finance Corp**	5,38 %	15.08.2027	3.624.335	0,16
9.406.000	Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp**	4,88 %	01.05.2029	8.757.974	0,39
6.415.000	Molina Healthcare Inc**	3,88 %	15.05.2032	5.612.508	0,25
3.675.000	Molina Healthcare Inc**	4,38 %	15.06.2028	3.479.321	0,15
2.315.000	Motion Bondco DAC**	6,63 %	15.11.2027	2.143.039	0,10
4.430.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,00 %	15.10.2027	3.622.597	0,16
5.250.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,25 %	01.08.2026	4.699.186	0,21
2.250.000	Murphy Oil USA Inc*	4,75 %	15.09.2029	2.134.350	0,10
5.590.000	Nabors Industries Inc**	7,38 %	15.05.2027	5.482.355	0,24
3.510.000	Nabors Industries Inc**	9,13 %	31.01.2030	3.527.287	0,16
1.695.000	Nabors Industries Ltd**	7,25 %	15.01.2026	1.630.963	0,07
1.745.000	Nabors Industries Ltd**	7,50 %	15.01.2028	1.510.793	0,07
1.840.000	NCL Corp Ltd**	5,88 %	15.03.2026	1.799.249	0,08
4.509.000	NCL Corp Ltd**	5,88 %	15.02.2027	4.472.894	0,20
3.770.000	Necessity Retail REIT Inc/American Finance Operating Partner LP**	4,50 %	30.09.2028	3.178.826	0,14
6.850.000	Neptune Bidco US Inc**	9,29 %	15.04.2029	6.393.226	0,28
20.235.000	New Fortress Energy Inc**	6,50 %	30.09.2026	19.452.065	0,86
3.220.000	Newell Brands Inc**	5,20 %	01.04.2026	3.177.821	0,14
1.790.000	Newell Brands Inc**	6,38 %	01.04.2036	1.640.322	0,07
8.035.000	Newfold Digital Holdings Group Inc**	6,00 %	15.02.2029	6.078.726	0,27
4.090.000	NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC**	7,13 %	01.04.2026	3.933.565	0,17
6.140.000	Northern Oil & Gas Inc**	8,13 %	01.03.2028	6.223.136	0,28
355.000	Northern Oil & Gas Inc**	8,75 %	15.06.2031	370.211	0,02
6.985.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	4,75 %	30.04.2027	6.676.228	0,30
2.547.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	6,00 %	15.02.2028	2.357.340	0,10
4.655.000	NOVA Chemicals Corp**	5,25 %	01.06.2027	4.369.830	0,19
1.555.000	NOVA Chemicals Corp**	8,50 %	15.11.2028	1.632.610	0,07
3.165.000	Novelis Corp**	4,75 %	30.01.2030	2.981.599	0,13
253.000	NRG Energy Inc**	3,88 %	15.02.2032	216.878	0,01
8.150.000	NRG Energy Inc**	5,25 %	15.06.2029	7.901.562	0,35
8.075.000	NRG Energy Inc**	10,25 %	29.12.2049	8.414.804	0,37
2.120.000	NuStar Logistics LP*	6,00 %	01.06.2026	2.118.166	0,09

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
3.355.000	Olympus Water US Holding Corp**	4,25 %	01.10.2028	3.022.719	0,13
2.770.000	Olympus Water US Holding Corp**	6,25 %	01.10.2029	2.463.335	0,11
4.300.000	Olympus Water US Holding Corp**	9,75 %	15.11.2028	4.569.365	0,20
1.965.000	ON Semiconductor Corp**	3,88 %	01.09.2028	1.824.300	0,08
1.665.000	OneMain Finance Corp*	3,50 %	15.01.2027	1.542.055	0,07
1.710.000	OneMain Finance Corp*	3,88 %	15.09.2028	1.514.316	0,07
2.265.000	OneMain Finance Corp*	5,38 %	15.11.2029	2.124.249	0,09
1.995.000	OneMain Finance Corp**	6,88 %	15.03.2025	2.021.105	0,09
2.260.000	OneMain Finance Corp**	7,13 %	15.03.2026	2.303.989	0,10
375.000	OneMain Finance Corp*	9,00 %	15.01.2029	396.780	0,02
20.000	Open Text Corp**	3,88 %	01.12.2029	17.957	0,00
3.020.000	Open Text Holdings Inc**	4,13 %	15.02.2030	2.736.542	0,12
2.905.000	Open Text Holdings Inc**	4,13 %	01.12.2031	2.573.284	0,11
360.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC**	4,00 %	15.10.2027	336.825	0,02
7.715.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc**	4,38 %	15.10.2028	7.220.429	0,32
3.595.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	4,88 %	15.05.2029	3.331.634	0,15
6.385.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	5,88 %	01.10.2028	6.285.364	0,28
2.545.000	Penn Entertainment Inc**	4,13 %	01.07.2029	2.178.886	0,10
3.615.000	Penn Entertainment Inc**	5,63 %	15.01.2027	3.507.881	0,16
1.490.000	Performance Food Group Inc**	4,25 %	01.08.2029	1.368.137	0,06
5.641.000	Performance Food Group Inc**	5,50 %	15.10.2027	5.564.303	0,25
2.048.000	Permian Resources Operating LLC**	5,38 %	15.01.2026	2.022.540	0,09
5.145.000	Permian Resources Operating LLC**	5,88 %	01.07.2029	5.022.960	0,22
3.100.000	Permian Resources Operating LLC**	7,00 %	15.01.2032	3.200.495	0,14
2.890.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**	4,75 %	15.02.2028	2.726.785	0,12
3.395.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**	7,75 %	15.02.2029	3.305.535	0,15
3.950.000	Pilgrim's Pride Corp**	3,50 %	01.03.2032	3.344.524	0,15
8.440.000	Pilgrim's Pride Corp**	4,25 %	15.04.2031	7.633.661	0,34
6.945.000	Pilgrim's Pride Corp**	6,25 %	01.07.2033	7.154.558	0,32
4.920.000	Pilgrim's Pride Corp**	6,88 %	15.05.2034	5.317.698	0,24
3.335.000	PNC Financial Services Group Inc**	3,40 %	29.12.2049	2.676.086	0,12
6.395.000	Presidio Holdings Inc**	8,25 %	01.02.2028	6.467.276	0,29
7.710.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75 %	15.04.2026	7.756.630	0,34
9.456.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25 %	15.01.2028	9.408.234	0,42
14.365.000	Rackspace Technology Global Inc**	3,50 %	15.02.2028	5.783.417	0,26
3.740.000	Rackspace Technology Global Inc**	5,38 %	01.12.2028	1.346.755	0,06
3.170.000	Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc**	6,50 %	15.09.2028	1.556.373	0,07
4.117.000	Raptor Acquisition Corp/Raptor Co-Issuer LLC**	4,88 %	01.11.2026	3.928.005	0,17
6.401.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,25 %	15.04.2030	4.785.596	0,21
5.305.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,75 %	15.01.2029	4.128.744	0,18

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
3.405.000	Regal Rexnord Corp**	6,30 %	15.02.2030	3.496.300	0,16
2.200.000	Regal Rexnord Corp**	6,40 %	15.04.2033	2.294.785	0,10
2.050.000	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc/LifePoint Health Inc**	9,75 %	01.12.2026	2.036.071	0,09
5.670.000	Resideo Funding Inc**	4,00 %	01.09.2029	4.954.446	0,22
3.323.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,50 %	15.02.2029	3.093.233	0,14
4.095.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	7,25 %	15.07.2028	4.260.076	0,19
2.770.000	RingCentral Inc**	8,50 %	15.08.2030	2.835.330	0,13
2.490.000	Ritchie Bros Holdings Inc**	6,75 %	15.03.2028	2.566.748	0,11
5.850.000	Ritchie Bros Holdings Inc**	7,75 %	15.03.2031	6.244.056	0,28
6.650.000	RLJ Lodging Trust LP**	4,00 %	15.09.2029	5.982.694	0,27
7.620.000	Rockcliff Energy II LLC**	5,50 %	15.10.2029	7.211.974	0,32
3.025.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	4,25 %	01.07.2026	2.923.659	0,13
8.160.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	01.04.2028	8.061.132	0,36
5.625.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	9,25 %	15.01.2029	6.054.064	0,27
8.670.000	Scientific Games Holdings LP/Scientific Games US FinCo Inc**	6,63 %	01.03.2030	8.207.152	0,36
2.800.000	SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC**	5,38 %	01.11.2026	2.691.128	0,12
6.915.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc**	5,25 %	15.08.2029	6.472.344	0,29
4.555.000	Select Medical Corp**	6,25 %	15.08.2026	4.580.708	0,20
5.535.000	Sensata Technologies BV**	4,00 %	15.04.2029	5.149.903	0,23
400.000	Sensata Technologies BV**	5,00 %	01.10.2025	400.733	0,02
1.305.000	Sensata Technologies BV**	5,88 %	01.09.2030	1.297.929	0,06
2.450.000	Service Properties Trust**	3,95 %	15.01.2028	2.010.404	0,09
6.035.000	Service Properties Trust**	8,63 %	15.11.2031	6.326.267	0,28
4.253.000	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**	4,75 %	15.02.2028	4.003.115	0,18
2.890.000	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**	4,75 %	01.04.2029	2.673.944	0,12
3.595.000	Sirius XM Radio Inc**	3,88 %	01.09.2031	3.079.949	0,14
1.230.000	Sirius XM Radio Inc**	4,00 %	15.07.2028	1.138.344	0,05
5.260.000	Sirius XM Radio Inc**	4,13 %	01.07.2030	4.693.984	0,21
4.470.000	Sirius XM Radio Inc**	5,50 %	01.07.2029	4.326.580	0,19
2.470.000	Six Flags Entertainment Corp**	5,50 %	15.04.2027	2.416.612	0,11
4.200.000	Six Flags Entertainment Corp**	7,25 %	15.05.2031	4.215.666	0,19
1.285.000	SNF Group SACA**	3,13 %	15.03.2027	1.170.431	0,05
3.150.000	SNF Group SACA**	3,38 %	15.03.2030	2.709.763	0,12
7.675.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63 %	01.04.2026	7.787.846	0,35
5.500.000	SPX FLOW Inc**	8,75 %	01.04.2030	5.506.325	0,24
2.265.000	SRS Distribution Inc**	6,00 %	01.12.2029	2.114.528	0,09
3.075.000	SRS Distribution Inc**	6,13 %	01.07.2029	2.918.898	0,13
6.770.000	Standard Industries Inc**	4,38 %	15.07.2030	6.225.578	0,28
3.405.000	Star Parent Inc**	9,00 %	01.10.2030	3.592.626	0,16
3.655.000	Station Casinos LLC**	4,50 %	15.02.2028	3.448.817	0,15

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
2.440.000	Station Casinos LLC**	4,63 %	01.12.2031	2.202.550	0,10
2.950.000	Summer BC Bidco B LLC**	5,50 %	31.10.2026	2.765.935	0,12
3.370.000	Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp**	7,25 %	15.01.2031	3.553.089	0,16
6.770.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp**	9,00 %	15.10.2026	6.723.184	0,30
2.854.000	Sunnova Energy Corp**	5,88 %	01.09.2026	2.432.008	0,11
4.820.000	Sunnova Energy Corp**	11,75 %	01.10.2028	4.390.610	0,20
4.265.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50 %	15.01.2028	4.034.918	0,18
1.470.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	01.03.2027	1.438.968	0,06
210.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	31.12.2030	195.516	0,01
3.460.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	01.09.2031	3.205.225	0,14
4.430.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	7,50 %	01.10.2025	4.456.779	0,20
2.530.000	Taylor Morrison Communities Inc**	5,13 %	01.08.2030	2.450.242	0,11
6.980.000	Team Health Holdings Inc†	13,50 %	30.06.2028	6.840.400	0,30
1.345.000	TEGNA Inc**	4,75 %	15.03.2026	1.309.290	0,06
2.510.000	Telecom Italia Capital SA**	6,38 %	15.11.2033	2.458.313	0,11
1.000.000	Telecom Italia Capital SA**	7,20 %	18.07.2036	1.005.144	0,04
3.465.000	Tenet Healthcare Corp**	4,88 %	01.01.2026	3.428.400	0,15
3.465.000	Tenet Healthcare Corp**	5,13 %	01.11.2027	3.389.727	0,15
6.120.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	01.10.2028	6.108.066	0,27
4.515.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	15.06.2030	4.570.702	0,20
9.805.000	Tenet Healthcare Corp**	6,75 %	15.05.2031	10.033.456	0,45
4.430.000	Terex Corp**	5,00 %	15.05.2029	4.180.170	0,19
6.350.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**	7,88 %	15.09.2029	6.851.720	0,30
1.455.000	Thor Industries Inc**	4,00 %	15.10.2029	1.299.591	0,06
1.190.000	TK Elevator Holdco GmbH**	7,63 %	15.07.2028	1.170.354	0,05
2.440.000	TK Elevator US Newco Inc**	5,25 %	15.07.2027	2.398.610	0,11
4.483.000	TMS International Corp**	6,25 %	15.04.2029	3.704.549	0,16
5.505.000	TransAlta Corp*	7,75 %	15.11.2029	5.851.126	0,26
3.510.000	TransDigm Inc*	5,50 %	15.11.2027	3.441.774	0,15
4.110.000	TransDigm Inc**	6,25 %	15.03.2026	4.107.071	0,18
12.425.000	TransDigm Inc**	6,75 %	15.08.2028	12.727.325	0,57
8.405.000	TransDigm Inc**	6,88 %	15.12.2030	8.662.655	0,38
3.350.000	TransDigm Inc*	7,50 %	15.03.2027	3.369.065	0,15
3.880.000	TreeHouse Foods Inc*	4,00 %	01.09.2028	3.439.424	0,15
1.835.000	Tri Pointe Homes Inc*	5,25 %	01.06.2027	1.804.970	0,08
4.245.000	Trident TPI Holdings Inc**	12,75 %	31.12.2028	4.547.456	0,20
4.030.000	Trivium Packaging Finance BV*	5,50 %	15.08.2026	3.958.080	0,18
7.410.000	Trivium Packaging Finance BV*	8,50 %	15.08.2027	7.273.869	0,32
4.385.000	Tronox Inc**	4,63 %	15.03.2029	3.887.273	0,17
1.510.000	TTM Technologies Inc**	4,00 %	01.03.2029	1.373.481	0,06

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
9.580.000	United Airlines Inc**	4,38 %	15.04.2026	9.342.323	0,42
4.785.000	United Airlines Inc**	4,63 %	15.04.2029	4.480.102	0,20
4.680.000	United Rentals North America Inc*	3,75 %	15.01.2032	4.146.136	0,18
1.430.000	United Rentals North America Inc*	4,00 %	15.07.2030	1.318.734	0,06
1.195.000	United Rentals North America Inc*	4,88 %	15.01.2028	1.167.527	0,05
1.905.000	United Rentals North America Inc*	5,25 %	15.01.2030	1.877.884	0,08
920.000	United States Cellular Corp*	6,70 %	15.12.2033	938.612	0,04
6.370.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	10,50 %	15.02.2028	6.463.384	0,29
1.235.000	US Acute Care Solutions LLC**	6,38 %	01.03.2026	1.033.325	0,05
2.965.000	US Foods Inc**	4,63 %	01.06.2030	2.765.993	0,12
3.620.000	US Foods Inc**	4,75 %	15.02.2029	3.440.825	0,15
3.565.000	US Foods Inc**	6,88 %	15.09.2028	3.674.127	0,16
3.965.000	US Foods Inc**	7,25 %	15.01.2032	4.139.310	0,18
2.590.000	USI Inc**	7,50 %	15.01.2032	2.654.879	0,12
3.905.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC**	3,88 %	15.08.2029	3.547.496	0,16
3.805.000	Venture Global Calcasieu Pass LLC**	4,13 %	15.08.2031	3.357.098	0,15
2.500.000	Venture Global LNG Inc**	8,13 %	01.06.2028	2.527.018	0,11
2.950.000	Venture Global LNG Inc**	8,38 %	01.06.2031	2.952.913	0,13
5.235.000	Venture Global LNG Inc**	9,50 %	01.02.2029	5.542.776	0,25
3.350.000	Venture Global LNG Inc**	9,88 %	01.02.2032	3.491.584	0,16
5.580.000	Verde Purchaser LLC**	10,50 %	30.11.2030	5.629.662	0,25
65.000	Verscend Escrow Corp**	9,75 %	15.08.2026	65.497	0,00
1.405.000	Viasat Inc**	5,63 %	15.04.2027	1.360.820	0,06
1.695.000	Viasat Inc**	6,50 %	15.07.2028	1.393.883	0,06
6.715.000	Vibrantz Technologies Inc**	9,00 %	15.02.2030	5.333.195	0,24
7.630.000	VICI Properties LP*	5,13 %	15.05.2032	7.446.297	0,33
2.740.000	VICI Properties LP/VICI Note Co Inc**	4,13 %	15.08.2030	2.498.757	0,11
4.245.000	Victoria's Secret & Co**	4,63 %	15.07.2029	3.551.245	0,16
3.575.000	Viking Cruises Ltd**	5,88 %	15.09.2027	3.453.003	0,15
3.000.000	Viking Cruises Ltd**	9,13 %	15.07.2031	3.198.860	0,14
3.620.000	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd**	5,63 %	15.02.2029	3.532.613	0,16
7.440.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	6,38 %	01.02.2030	5.201.912	0,23
6.635.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	7,88 %	01.05.2027	5.714.436	0,25
3.695.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	9,50 %	01.06.2028	3.131.651	0,14
6.705.000	Vistra Corp**	7,00 %	29.12.2049	6.613.611	0,29
2.595.000	Vistra Operations Co LLC**	4,38 %	01.05.2029	2.425.336	0,11
7.565.000	Vistra Operations Co LLC**	7,75 %	15.10.2031	7.862.600	0,35
8.881.000	VM Consolidated Inc**	5,50 %	15.04.2029	8.394.883	0,37
6.930.000	Vmed O2 UK Financing I Plc**	4,75 %	15.07.2031	6.194.595	0,28
3.600.000	White Cap Buyer LLC**	6,88 %	15.10.2028	3.489.342	0,16

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 88,78 % (31. Dezember 2022: 86,24 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
3.575.000	White Cap Parent LLC**	8,25 %	15.03.2026	3.563.070	0,16
2.495.000	William Carter Co**	5,63 %	15.03.2027	2.465.371	0,11
4.615.000	Williams Scotsman Inc**	7,38 %	01.10.2031	4.842.898	0,22
6.995.000	Windsor Holdings III LLC**	8,50 %	15.06.2030	7.318.715	0,33
2.665.000	WMG Acquisition Corp**	3,75 %	01.12.2029	2.429.615	0,11
1.540.000	WMG Acquisition Corp**	3,88 %	15.07.2030	1.394.896	0,06
1.545.000	Wolverine World Wide Inc**	4,00 %	15.08.2029	1.214.772	0,05
2.920.000	WR Grace Holdings LLC**	5,63 %	15.08.2029	2.572.832	0,11
1.500.000	WR Grace Holdings LLC**	7,38 %	01.03.2031	1.502.850	0,07
2.445.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc**	4,38 %	15.08.2028	2.287.971	0,10
2.875.000	XHR LP**	4,88 %	01.06.2029	2.649.686	0,12
5.445.000	XHR LP**	6,38 %	15.08.2025	5.436.043	0,24
5.110.000	XPO Inc**	6,25 %	01.06.2028	5.180.952	0,23
2.240.000	XPO Inc**	7,13 %	01.02.2032	2.313.264	0,10
3.710.000	Yum! Brands Inc*	4,63 %	31.01.2032	3.473.356	0,15
3.530.000	Yum! Brands Inc**	4,75 %	15.01.2030	3.425.530	0,15
1.555.000	Zayo Group Holdings Inc**	4,00 %	01.03.2027	1.248.346	0,06
2.560.000	ZF North America Capital Inc**	4,75 %	29.04.2025	2.532.595	0,11
3.530.000	ZF North America Capital Inc**	6,88 %	14.04.2028	3.660.236	0,16
3.345.000	ZF North America Capital Inc**	7,13 %	14.04.2030	3.568.978	0,16
8.415.000	Ziff Davis Inc**	4,63 %	15.10.2030	7.729.558	0,34
3.840.000	ZipRecruiter Inc**	5,00 %	15.01.2030	3.356.969	0,15
4.185.000	ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp**	3,88 %	01.02.2029	3.798.389	0,17
	Unternehmensanleihen insgesamt			**1.999.177.351**	**88,78**
	Staatsanleihen 1,61 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
	US-Dollar				
35.890.000	United States Treasury Note/Bond	5,00 %	31.08.2025	36.225.768	1,61
	Staatsanleihen insgesamt *			**36.225.768**	**1,61**
	Mittelfristige Schuldverschreibungen 1,91 % (31. Dezember 2022: 3,99 %)				
	US-Dollar				
3.020.961	Cyxtera DC Holdings Inc	10,50 %	01.05.2024	1.922.131	0,08
5.415.847	Engineered Machinery Holdings Inc	11,61 %	21.05.2029	5.117.975	0,23
3.144.586	Fleetpride Inc	9,86 %	29.09.2028	3.146.064	0,14
2.784.261	Lightstone Holdco LLC B Term Loan	11,13 %	29.01.2027	2.657.230	0,12
157.454	Lightstone Holdco LLC C Term Loan	11,13 %	29.01.2027	150.270	0,01
3.760.000	New Fortress Energy Inc	10,39 %	30.10.2028	3.713.000	0,16
14.575.000	Parexel International Inc	11,97 %	15.11.2029	14.438.359	0,64
4.940	Starwood Property Mortgage LLC	8,71 %	26.07.2026	4.940	0,00

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mittelfristige Schuldverschreibungen 1,91 % (31. Dezember 2022: 3,99 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
3.004.900	Trident TPI Holdings Inc	9,85 %	15.09.2028	3.012.412	0,13
5.130.706	US Silica Co	10,21 %	25.03.2030	5.147.202	0,23
3.764.105	WaterBridge Midstream Operating LLC	11,39 %	22.06.2026	3.774.475	0,17
	Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt [†]			**43.084.058**	**1,91**

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Investmentfonds 0,16 % (31. Dezember 2022: 0,80 %)		
	Britisches Pfund		
4.058.488	NB Global Monthly Income Fund Ltd	3.611.285	0,16
	Investmentfonds insgesamt [µ]	**3.611.285**	**0,16**
	Anlagen insgesamt	**2.092.996.444**	**92,95**

Devisenterminkontrakte 1,81 % (31. Dezember 2022: 2,42 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
3.727.060 €	4.064.787 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	54.872	0,00
22.020.332 £	26.882.994 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	1.190.987	0,06
2.432.381 £	3.081.389 US$	18.01.2024	UBS AG	1	19.682	0,00
Abgesicherte Klassen AUD						
4.537.510 AUD	3.011.718 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	86.064	0,00
141.569.969 AUD	91.149.395 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	40	5.501.163	0,24
117.587 US$	171.483 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	514	0,00
Abgesicherte Klassen CAD						
398.813 CAD	294.880 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	7.642	0,00
10.815.206 CAD	7.969.319 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	234.585	0,01
Abgesicherte Klassen CHF						
92.220 CHF	106.314 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	3.435	0,00
254.953 CHF	287.862 US$	18.01.2024	UBS AG	5	15.551	0,00
8.754.231 CHF	9.784.013 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	634.230	0,03
Abgesicherte Klassen CNY						
462.200 CNY	64.135 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	846	0,00
35.484.025 CNY	4.884.776 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	8	103.940	0,01
Abgesicherte Klassen EUR						
4.712.006 €	5.099.045 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	109.312	0,01
156.465.478 €	166.777.130 US$	18.01.2024	UBS AG	5	6.170.041	0,27
157.875.377 €	168.234.666 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	43	6.270.917	0,28
30.726 US$	27.651 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	163	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
1.855.500 £	2.344.658 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	20.941	0,00
259.700.344 £	318.921.929 US$	18.01.2024	UBS AG	3	12.173.097	0,54

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,81 % (31. Dezember 2022: 2,42 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen GBP (Fortsetzung)						
16.940.740 £	21.134.605 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	46	463.344	0,02
130.992 US$	102.630 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	148	0,00
Abgesicherte Klassen HKD						
644.920 HKD	82.539 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	81	0,00
957.404 HKD	122.552 US$	18.01.2024	UBS AG	3	100	0,00
53.021.537 HKD	6.791.084 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	1.449	0,00
Abgesicherte Klassen SEK						
48.163.024 SEK	4.438.782 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	343.363	0,02
1.155.016 SEK	112.533 US$	18.01.2024	UBS AG	1	2.149	0,00
491.528.732 SEK	48.308.582 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	27	495.696	0,02
7 US$	66 SEK	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	1	0,00
Abgesicherte Klassen SGD						
25.805.675 SGD	18.993.752 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	583.648	0,03
387.101 SGD	290.868 US$	18.01.2024	UBS AG	1	2.805	0,00
1.777.482 SGD	1.329.005 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	10	19.478	0,00
Abgesicherte Klassen ZAR						
64.102 US$	1.172.810 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	56	0,00
2.244.887.699 ZAR	116.419.522 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	6.172.105	0,27
45.725.881 ZAR	2.487.906 US$	18.01.2024	UBS AG	3	9.151	0,00
18.391.800 ZAR	986.698 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	36	17.667	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞]					**40.709.223**	**1,81**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**2.133.705.667**	**94,76**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,69 %) (31. Dezember 2022: (1,09 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
32.239.001 US$	26.404.677 £	18.01.2024	UBS AG	1	(1.424.632)	(0,07)
3.814.559 US$	3.602.175 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(167.060)	(0,01)
1.121.016 US$	918.143 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(49.536)	(0,00)
145 US$	200 CAD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(6)	(0,00)
Abgesicherte Klassen AUD						
715.090 AUD	489.510 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(1.314)	(0,00)
601.110 US$	945.907 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(44.666)	(0,00)
401.155 US$	626.952 AUD	18.01.2024	UBS AG	1	(26.868)	(0,00)
13.047.787 US$	20.177.316 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	66	(727.370)	(0,03)

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,69 %) (31. Dezember 2022: (1,09 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen CAD						
45.591 US$	62.631 CAD	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(1.917)	(0,00)
3.794.444 US$	5.149.605 CAD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(111.801)	(0,01)
Abgesicherte Klassen CHF						
34.048 CHF	40.562 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(43)	(0,00)
50.345 US$	44.794 CHF	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(2.964)	(0,00)
65.482 US$	58.282 CHF	18.01.2024	UBS AG	2	(3.878)	(0,00)
3.869.874 US$	3.460.395 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	11	(248.275)	(0,01)
Abgesicherte Klassen CNY						
69.679 CNY	9.805 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(9)	(0,00)
8.151 US$	59.296 CNY	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(186)	(0,00)
3.327.726 US$	24.175.824 CNY	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	(71.163)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
900.018 €	997.208 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(2.385)	(0,00)
93 €	104 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
2.114.191 US$	1.995.318 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(91.309)	(0,01)
88.738.344 US$	83.262.502 €	18.01.2024	UBS AG	1	(3.294.827)	(0,15)
95.315.219 US$	89.418.976 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	60	(3.522.930)	(0,16)
Abgesicherte Klassen GBP						
209.142 £	267.000 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	5	(362)	(0,00)
3.156.056 US$	2.596.912 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(154.778)	(0,01)
102.364.666 US$	83.356.982 £	18.01.2024	UBS AG	2	(3.908.132)	(0,17)
9.284.919 US$	7.530.334 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	54	(315.593)	(0,01)
Abgesicherte Klassen HKD						
884.700 HKD	113.411 US$	18.01.2024	UBS AG	2	(73)	(0,00)
25.455 US$	198.925 HKD	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(30)	(0,00)
64.127 US$	500.950 HKD	18.01.2024	UBS AG	2	(49)	(0,00)
2.321.386 US$	18.124.281 HKD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(496)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SEK						
4.588.184 SEK	460.110 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(4.545)	(0,00)
216.240.920 SEK	21.617.162 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(146.429)	(0,01)
1.079.594 US$	11.726.655 SEK	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	(84.756)	(0,00)
1.223.974 US$	13.167.536 SEK	18.01.2024	Westpac Banking Corp	42	(83.442)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SGD						
138.841 SGD	105.338 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(7)	(0,00)
2.098.484 US$	2.852.085 SGD	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(65.241)	(0,00)
941.854 US$	1.261.419 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	8	(15.118)	(0,00)
Abgesicherte Klassen ZAR						
13.324.678 US$	256.447.325 ZAR	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(679.717)	(0,03)
5.137.181 US$	96.605.146 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	74	(138.353)	(0,01)
16.723.513 ZAR	914.335 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(1.077)	(0,00)

High Yield Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,69 %) (31. Dezember 2022: (1,09 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen ZAR (Fortsetzung)						
2.413.198 ZAR	131.851 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(68)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(15.391.406)**	**(0,69)**

Total Return Swap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,02 %))

Nominalwert		Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
USD	25.000.000	20.03.2024	5,38[1]	iBoxx USD Liquid High Yield Index[2]	(51.928)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten ∞					**(51.928)**	**(0,00)**

[1] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

[2] Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die JPMorgan Chase Bank.

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(15.443.334)**	**(0,69)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**2.118.262.333**	**94,07**
Sonstiges Nettovermögen	**133.548.386**	**5,93**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**2.251.810.719**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	210.494.768	9,23
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.828.965.933	80,19
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	49.924.458	2,19
µ	Investmentfonds	3.611.285	0,16
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	25.265.889	1,11
Anlagen insgesamt		**2.118.262.333**	**92,88**

InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Aktien 94,76 % (31. Dezember 2022: 94,06 %)		
	Australischer Dollar		
5.440	Altium Ltd*	173.907	0,73
	Australischer Dollar insgesamt	**173.907**	**0,73**
	Chinesischer Yuan Renminbi		
84.273	Shenzhen Sinexcel Electric Co Ltd Class A*	353.988	1,49
41.050	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A*	254.177	1,07
96.800	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd Class A*	399.674	1,68
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt	**1.007.839**	**4,24**
	Indische Rupie		
62.542	Bharti Airtel Ltd*	774.130	3,26
8.341	Polycab India Ltd*	551.082	2,32
31.696	Syrma SGS Technology Ltd*	254.250	1,07
34.360	Tech Mahindra Ltd*	525.555	2,21
420.391	Zomato Ltd*	624.925	2,63
	Indische Rupie insgesamt	**2.729.942**	**11,49**
	Japanischer Yen		
1.700	Disco Corp*	421.804	1,78
9.200	Enplas Corp*	783.090	3,29
30.700	Harmonic Drive Systems Inc*	905.887	3,81
15.700	JMDC Inc*	474.742	2,00
11.100	M3 Inc*	183.688	0,77
38.300	Mercari Inc*	709.737	2,99
12.400	Nitto Boseki Co Ltd*	404.157	1,70
34.400	Rohm Co Ltd*	659.427	2,77
45.500	Sansan Inc*	516.063	2,17
11.100	Shibaura Mechatronics Corp*	467.683	1,97
1.300	SMC Corp*	698.595	2,94
	Japanischer Yen insgesamt	**6.224.873**	**26,19**
	Malaysischer Ringgit		
734.400	Inari Amertron Bhd*	481.076	2,02
	Malaysischer Ringgit insgesamt	**481.076**	**2,02**
	Neuer taiwanesischer Dollar		
37.000	Accton Technology Corp*	630.521	2,65
20.000	E Ink Holdings Inc*	128.379	0,54
9.000	eMemory Technology Inc*	718.463	3,02

InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 94,76 % (31. Dezember 2022: 94,06 %) (Fortsetzung)		
	Neuer taiwanesischer Dollar (Fortsetzung)		
29.000	Faraday Technology Corp*	337.336	1,42
6.000	Global Unichip Corp*	340.171	1,43
34.499	Jentech Precision Industrial Co Ltd*	864.428	3,64
42.000	Novatek Microelectronics Corp*	707.515	2,98
29.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd*	560.336	2,36
105.000	Taiwan Union Technology Corp*	431.078	1,81
14.000	WinWay Technology Co Ltd*	382.724	1,61
118.000	Wistron Corp*	379.101	1,59
	Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt	**5.480.052**	**23,05**
	Singapur-Dollar		
214.700	AEM Holdings Ltd**	563.158	2,37
	Singapur-Dollar insgesamt	**563.158**	**2,37**
	Südkoreanischer Won		
12.816	HAESUNG DS Co Ltd*	551.290	2,32
11.235	Hanmi Semiconductor Co Ltd*	538.240	2,26
13.042	HPSP Co Ltd*	444.050	1,87
6.188	JYP Entertainment Corp*	486.718	2,05
2.338	LEENO Industrial Inc*	367.610	1,55
9.135	SK Hynix Inc*	1.003.652	4,22
	Südkoreanischer Won insgesamt	**3.391.560**	**14,27**
	Thailändischer Baht		
70.700	Delta Electronics Thailand PCL*	182.278	0,77
179.000	Hana Microelectronics PCL*	279.257	1,17
157.400	KCE Electronics PCL*	253.629	1,07
	Thailändischer Baht insgesamt	**715.164**	**3,01**
	US-Dollar		
4.501	Fabrinet*	856.675	3,60
7.268	Kanzhun Ltd ADR*	120.722	0,51
3.154	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR*	231.125	0,97
	US-Dollar insgesamt	**1.208.522**	**5,08**
	Vietnamesischer Dong		
138.552	FPT Corp*	548.794	2,31
	Vietnamesischer Dong insgesamt	**548.794**	**2,31**
	Aktien insgesamt	**22.524.887**	**94,76**
	Anlagen insgesamt	**22.524.887**	**94,76**

InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,26 % (31. Dezember 2022: 3,07 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen CHF						
531.695 CHF	595.388 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	8	37.371	0,16
63.284 CHF	71.251 US$	18.01.2024	UBS AG	8	4.062	0,02
39.998 CHF	45.265 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	6	2.334	0,01
Abgesicherte Klassen EUR						
232.650 €	250.588 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	5	6.569	0,03
5.251.244 €	5.601.452 US$	18.01.2024	UBS AG	9	202.946	0,85
466.356 €	504.327 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	8	11.154	0,05
16.024 US$	14.420 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	85	0,00
Abgesicherte Klassen SGD						
58.459 SGD	43.481 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	5	869	0,00
1.595.311 SGD	1.176.531 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	16	33.745	0,14
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**299.135**	**1,26**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**22.824.022**	**96,02**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,25 %) (31. Dezember 2022: (0,53 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen CHF						
13.154 CHF	15.680 US$	18.01.2024	UBS AG	2	(26)	(0,00)
15.053 US$	13.325 CHF	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(805)	(0,00)
67.715 US$	59.726 CHF	18.01.2024	UBS AG	11	(3.365)	(0,01)
56.806 US$	50.313 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(3.070)	(0,01)
Abgesicherte Klassen EUR						
120.365 €	133.297 US$	18.01.2024	UBS AG	2	(254)	(0,00)
143.980 US$	135.651 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(5.960)	(0,03)
278.876 US$	259.914 €	18.01.2024	UBS AG	6	(8.416)	(0,04)
915.592 US$	857.558 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	11	(32.300)	(0,14)
Abgesicherte Klassen SGD						
12.858 SGD	9.756 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(2)	(0,00)
21.828 SGD	16.561 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
37.001 US$	50.280 SGD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(1.145)	(0,00)
76.740 US$	103.784 SGD	18.01.2024	UBS AG	5	(1.995)	(0,01)
114.236 US$	154.263 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	10	(2.797)	(0,01)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(60.136)**	**(0,25)**

InnovAsia 5G - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(60.136)**	**(0,25)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**22.763.886**	**95,77**
Sonstiges Nettovermögen	**1.006.234**	**4,23**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**23.770.120**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	21.961.729	91,60
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	563.158	2,35
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	238.999	1,00
Anlagen insgesamt		**22.763.886**	**94,95**

Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert JPY	% des Netto-vermögens
	Aktien 98,67 % (31. Dezember 2022: 98,37 %)		
	Japanischer Yen		
65.000	ABC-Mart Inc	160.225.000	0,99
420.000	Amada Co Ltd	617.400.000	3,82
26.000	Appier Group Inc	48.100.000	0,30
50.000	As One Corp	280.000.000	1,73
48.000	Asahi Intecc Co Ltd	137.688.000	0,85
59.000	Asics Corp	260.662.000	1,61
10.000	BML Inc	30.000.000	0,19
3.500	Cover Corp	9.583.000	0,06
178.000	Daiei Kankyo Co Ltd	443.754.000	2,74
360.000	Daiwa Industries Ltd	543.600.000	3,36
85.000	eGuarantee Inc	174.080.000	1,08
46.000	eWeLL Co Ltd	92.506.000	0,57
214.000	FP Partner Inc	1.110.660.000	6,87
28.000	Fujimi Inc	87.780.000	0,54
11.000	Genda Inc	31.427.000	0,19
4.000	GMO Financial Gate Inc	41.840.000	0,26
65.000	Hokkoku Financial Holdings Inc	300.300.000	1,86
25.000	Human Technologies Inc	33.625.000	0,21
24.000	Inforich Inc	118.560.000	0,73
37.000	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	86.506.000	0,53
260.000	JSB Co Ltd	652.080.000	4,03
56.000	Justsystems Corp	183.400.000	1,13
120.000	Kansai Paint Co Ltd	289.080.000	1,79
29.000	Keisei Electric Railway Co Ltd	193.256.000	1,19
451.000	Kosaido Holdings Co Ltd	342.760.000	2,12
15.000	Lawson Inc	109.245.000	0,68
31.000	M&A Research Institute Holdings Inc	138.725.000	0,86
12.000	Macnica Holdings Inc	89.244.000	0,55
53.000	MEC Co Ltd	232.935.000	1,44
153.000	Menicon Co Ltd	359.397.000	2,22
100.000	MISUMI Group Inc	238.950.000	1,48
22.000	Mitsubishi Logistics Corp	93.478.000	0,58
39.000	Mitsubishi Pencil Co Ltd	81.354.000	0,50
130.000	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	196.300.000	1,21
94.000	Nifco Inc	342.630.000	2,12
60.000	Niterra Co Ltd	200.940.000	1,24
240.000	Okinawa Cellular Telephone Co	812.400.000	5,02
214.000	Open Up Group Inc	502.686.000	3,11
43.000	Osaka Soda Co Ltd	416.240.000	2,57

Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert JPY	% des Nettover-mögens
	Aktien 98,67 % (31. Dezember 2022: 98,37 %) (Fortsetzung)		
	Japanischer Yen (Fortsetzung)		
56.000	Pasona Group Inc	147.952.000	0,91
67.000	Pilot Corp	281.467.000	1,74
120.000	Resorttrust Inc	293.520.000	1,81
455.000	Ricoh Co Ltd	492.765.000	3,05
60.000	Sakai Moving Service Co Ltd	163.200.000	1,01
29.000	San-A Co Ltd	132.095.000	0,82
15.000	SHO-BOND Holdings Co Ltd	94.005.000	0,58
120.000	Shoei Co Ltd	220.800.000	1,36
10.000	St Cousair Co Ltd	25.880.000	0,16
63.000	TBS Holdings Inc	188.937.000	1,17
90.000	TKC Corp	338.400.000	2,09
64.000	TKP Corp	115.072.000	0,71
96.000	Tokyo Century Corp	146.592.000	0,91
35.000	Tokyo Seimitsu Co Ltd	303.485.000	1,88
25.000	Tokyotokeiba Co Ltd	110.875.000	0,69
600.000	Tokyu Fudosan Holdings Corp	540.840.000	3,34
235.000	Transaction Co Ltd	501.725.000	3,10
222.000	TRYT Inc	126.318.000	0,78
184.000	USS Co Ltd	521.824.000	3,23
55.000	WingArc1st Inc	169.125.000	1,05
20.000	Yamaha Corp	65.140.000	0,40
320.000	Yamanashi Chuo Bank Ltd	537.920.000	3,32
80.000	Yokogawa Electric Corp	215.120.000	1,33
36.000	Zuken Inc	145.440.000	0,90
	Aktien insgesamt *	**15.961.893.000**	**98,67**
	Anlagen insgesamt	**15.961.893.000**	**98,67**

Devisenterminkontrakte 0,79 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn JPY	% des Nettover-mögens
215 £	38.497 ¥	09.01.2024	Brown Brothers Harriman	5	45	0,00
671 £	120.491 ¥	05.01.2024	Brown Brothers Harriman	5	1	0,00
7.946.271 ¥	43.833 £	04.01.2024	Brown Brothers Harriman	3	69.676	0,00
28.392 ¥	158 £	05.01.2024	Brown Brothers Harriman	2	0	0,00
Abgesicherte Klassen EUR						
740 €	114.131 ¥	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	901	0,00
468.489.324 ¥	2.995.444 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	6	2.852.150	0,02
291.393.419 ¥	1.853.022 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	9	3.343.987	0,02
9.865.576.727 ¥	62.679.763 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	122.103.474	0,75

Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,79 % (31. Dezember 2022: 0,22 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn JPY	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen GBP						
14.036 £	2.513.266 ¥	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	3.499	0,00
2.260.915 ¥	12.564 £	18.01.2024	Standard Chartered Bank	3	8.091	0,00
9.561.820 ¥	52.756 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	13	102.255	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞]					**128.484.079**	**0,79**

	Zeitwert JPY	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**16.090.377.079**	**99,46**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,26 %) (31. Dezember 2022: (0,69 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust JPY	% des Nettover-mögens
14.052 £	2.547.444 ¥	04.01.2024	Brown Brothers Harriman	8	(22.337)	(0,00)
1.095.536 ¥	6.108 £	09.01.2024	Brown Brothers Harriman	4	(1.271)	(0,00)
473.739 ¥	2.637 £	05.01.2024	Brown Brothers Harriman	2	(11)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
1.360.046 €	212.269.012 ¥	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(851.944)	(0,00)
66.143.954 €	10.320.450.468 ¥	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	15	(38.474.067)	(0,24)
936.620 €	147.019.903 ¥	18.01.2024	Westpac Banking Corp	5	(1.423.816)	(0,01)
84.913 ¥	550 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(584)	(0,00)
136.027.230 ¥	880.642 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(867.221)	(0,01)
33.482 ¥	216 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(95)	(0,00)
Abgesicherte Klassen GBP						
318.781 £	57.339.575 ¥	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(179.661)	(0,00)
70.994 £	12.903.034 ¥	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	18	(173.251)	(0,00)
8.070 £	1.449.667 ¥	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(2.652)	(0,00)
640.347 ¥	3.601 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(5.342)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞]					**(42.002.252)**	**(0,26)**

	Zeitwert JPY	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(42.002.252)**	**(0,26)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**16.048.374.827**	**99,20**
Sonstiges Nettovermögen	**129.153.888**	**0,80**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**16.177.528.715**	**100,00**

Japan Equity Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

	Portfolioanalyse	JPY	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	15.961.893.000	98,32
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	86.481.827	0,53
Anlagen insgesamt		**16.048.374.827**	**98,85**

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Netto-vermögens
	Schatzwechsel 83,54 % (31. Dezember 2022: 13,93 %)				
	Euro				
300.000	Finland T-Bill	0,00 %	13.03.2024	297.782	10,33
650.000	Finland T-Bill	0,00 %	14.05.2024	641.126	22,25
550.000	France Treasury Bill BTF	0,00 %	12.06.2024	541.369	18,79
450.000	German Treasury Bill	0,00 %	17.04.2024	445.211	15,45
490.000	German Treasury Bill	0,00 %	19.06.2024	481.888	16,72
	Schatzwechsel insgesamt **			**2.407.376**	**83,54**
	Staatsanleihen 12,04 % (31. Dezember 2022: 8,82 %)				
	Euro				
350.000	French Republic Government Bond OAT	0,00 %	25.03.2024	347.166	12,04
	Staatsanleihen insgesamt *			**347.166**	**12,04**
	Anlagen insgesamt			**2.754.542**	**95,58**

Devisenterminkontrakte 160,57 % (31. Dezember 2022: 11,48 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettover-mögens
2.852.874 AUD	1.822.756 US$	18.01.2024	BNP Paribas	2	113.012	3,92
7.629.279 AUD	4.873.486 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	303.131	10,52
4.568.708 AUD	2.945.374 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	5	157.152	5,45
4.552.010 AUD	2.960.172 US$	18.01.2024	UBS AG	1	133.451	4,63
4.237.668 AUD	2.694.110 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	180.006	6,25
5.695.363 BRL	1.114.726 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	51.082	1,77
1.324.755 CAD	960.637 US$	18.01.2024	BNP Paribas	2	40.041	1,39
2.133.539 CAD	1.557.897 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	54.739	1,90
1.976.320 CAD	1.434.618 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	58.376	2,03
1.620.193 CAD	1.188.842 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	36.333	1,26
1.883.723 CAD	1.368.392 US$	18.01.2024	UBS AG	4	54.744	1,90
444.468 CAD	327.865 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	8.403	0,29
2.315.360 CHF	2.591.097 US$	18.01.2024	BNP Paribas	3	148.705	5,16
3.107.431 CHF	3.528.311 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	2	153.605	5,33
1.801.878 CHF	2.020.814 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	111.791	3,88
603.253 CHF	678.880 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	35.319	1,23
724.827 CHF	813.957 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	44.010	1,53
1.029.375 CHF	1.173.897 US$	18.01.2024	UBS AG	2	46.269	1,61
135.521 CHF	152.062 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	8.340	0,29

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 160,57 % (31. Dezember 2022: 11,48 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettover-mögens
279.027.059 CLP	300.627 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	16.865	0,58
616.851.210 CLP	660.440 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	41.049	1,42
15.252.551 CZK	656.435 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	23.226	0,81
2.239.677 CZK	99.179 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	888	0,03
7.354.180 €	7.829.077 US$	18.01.2024	BNP Paribas	9	271.210	9,41
2.782.268 €	2.966.488 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	98.484	3,42
577.655 €	620.902 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	15.925	0,55
569.109 €	611.960 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	15.468	0,54
1.762.637 €	1.919.636 US$	18.01.2024	UBS AG	2	25.942	0,90
314.892 €	333.832 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	12.874	0,45
1.883.944 £	2.309.425 US$	18.01.2024	BNP Paribas	5	83.628	2,90
1.288.214 £	1.601.926 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	36.580	1,27
1.534.592 £	1.871.386 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	76.975	2,67
251.738 £	310.566 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	9.388	0,33
487.112 £	596.889 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	21.836	0,76
529.712 £	659.769 US$	18.01.2024	UBS AG	1	14.083	0,49
65.368.101 HUF	176.013 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	11.298	0,39
165.271.276 HUF	457.231 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	17.515	0,61
40.456.962 HUF	114.783 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	1.702	0,06
18.076.133 IDR	1.146 US$	18.01.2024	UBS AG	1	24	0,00
33.875.351 ¥	230.567 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	9.316	0,32
12.578.384 ¥	86.002 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	3.107	0,11
400.092.780 ¥	2.695.316 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	135.225	4,69
229.381.639 ¥	1.564.325 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	60.299	2,09
32.141.567 ¥	227.635 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	815	0,03
137.980.589 ¥	925.646 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	50.156	1,74
702.377 KRW	527 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	13	0,00
38.914.647 MXN	2.114.058 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	160.961	5,58
10.676.500 MXN	603.022 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	23.339	0,81
6.084.280 NOK	553.361 US$	18.01.2024	BNP Paribas	3	41.598	1,44
1.378.859 NOK	127.866 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	7.202	0,25
5.027.941 NOK	455.560 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	35.940	1,25
6.383.998 NOK	582.690 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	41.775	1,45
24.959.176 NOK	2.284.160 US$	18.01.2024	UBS AG	4	157.855	5,48
575.947 NZD	346.887 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	16.100	0,56
3.705.800 NZD	2.174.309 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	155.754	5,40
3.658.698 NZD	2.139.652 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	4	160.126	5,56
1.125.307 NZD	668.620 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	39.727	1,38
1.269.426 PLN	299.336 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	21.189	0,73
3.274.344 PLN	802.351 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	4	27.290	0,95

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 160,57 % (31. Dezember 2022: 11,48 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Nettover-mögens
3.020.920 PLN	717.052 US$	18.01.2024	UBS AG	3	46.167	1,60
25.879.864 SEK	2.370.321 US$	18.01.2024	BNP Paribas	5	180.317	6,26
87.849.997 SEK	8.371.942 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	317.326	11,01
14.214.889 SEK	1.306.167 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	95.211	3,30
4.095.471 SEK	398.009 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	7.811	0,27
172.819 ZAR	8.954 US$	18.01.2024	BNP Paribas	1	438	0,01
Abgesicherte Klassen GBP						
175.554 £	202.323 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	163	0,01
1.107 £	1.267 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	10	0,00
148 £	169 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	1	0,00
Abgesicherte Klassen SEK						
20.862 €	230.550 SEK	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	152	0,01
45.102 €	500.734 SEK	18.01.2024	Westpac Banking Corp	6	122	0,00
109.459 SEK	9.713 €	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	120	0,00
1.058.070 SEK	91.074 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	3.970	0,14
42.869.356 SEK	3.702.912 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	4	147.975	5,14
42.318.537 SEK	3.655.230 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	37	146.180	5,07
Abgesicherte Klassen USD						
562 €	604 US$	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	16	0,00
1.573 €	1.720 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	17	0,00
950 €	1.022 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	26	0,00
501 €	535 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	17	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞]					**4.627.295**	**160,57**

	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**7.381.837**	**256,15**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (160,09 %) (31. Dezember 2022: (14,06 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettover-mögens
1.188.658 US$	13.082.727 SEK	18.01.2024	BNP Paribas	4	(99.822)	(3,46)
175.838 US$	864.596 BRL	18.01.2024	BNP Paribas	1	(1.770)	(0,06)
1.670.174 US$	18.473.374 NOK	18.01.2024	BNP Paribas	4	(135.321)	(4,70)
886.259 US$	3.733.412 PLN	18.01.2024	BNP Paribas	2	(56.975)	(1,98)
1.970.424 US$	289.974.776 ¥	18.01.2024	BNP Paribas	3	(82.679)	(2,87)
631.917 US$	11.663.946 MXN	18.01.2024	BNP Paribas	1	(49.813)	(1,73)
2.851.371 US$	4.411.285 AUD	18.01.2024	BNP Paribas	6	(144.966)	(5,03)

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (160,09 %) (31. Dezember 2022: (14,06 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettover-mögens
178.331 US$	65.399.430 HUF	18.01.2024	BNP Paribas	1	(9.282)	(0,32)
5.115.992 US$	4.175.425 £	18.01.2024	BNP Paribas	4	(187.549)	(6,51)
2.994.461 US$	2.664.992 CHF	18.01.2024	BNP Paribas	5	(160.219)	(5,56)
314.240 US$	293.299.212 CLP	18.01.2024	BNP Paribas	1	(19.323)	(0,67)
2.982.970 US$	4.084.532 CAD	18.01.2024	BNP Paribas	5	(104.369)	(3,62)
1.228.413 US$	2.085.732 NZD	18.01.2024	BNP Paribas	2	(83.457)	(2,90)
2.531.671 US$	2.371.797 €	18.01.2024	BNP Paribas	4	(81.392)	(2,82)
109.860 US$	86.419 £	18.01.2024	Citibank NA	1	(286)	(0,01)
685.646 US$	102.541.909 ¥	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(39.317)	(1,36)
1.030.145 US$	1.727.817 NZD	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(57.800)	(2,01)
1.136.518 US$	1.067.961 €	18.01.2024	Deutsche Bank AG	2	(39.752)	(1,38)
754.437 US$	680.895 CHF	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(50.557)	(1,75)
2.584.454 US$	3.553.769 CAD	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	(100.664)	(3,49)
2.967.207 US$	2.788.215 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(103.781)	(3,60)
705.721 US$	12.910.077 MXN	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(49.441)	(1,72)
3.484.980 US$	37.924.228 SEK	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	(253.810)	(8,81)
846.969 US$	4.229.309 BRL	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	(20.574)	(0,71)
274.675 US$	245.463 CHF	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(15.784)	(0,55)
912.249 US$	3.831.196 PLN	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(55.955)	(1,94)
1.515.080 US$	2.549.219 NZD	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(89.616)	(3,11)
2.051.402 US$	3.203.024 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	(122.424)	(4,25)
295.752 US$	43.834.033 ¥	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(14.404)	(0,50)
638.568 US$	517.199 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(18.831)	(0,65)
7.664.505 US$	81.121.342 SEK	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(352.921)	(12,25)
621.711 US$	578.191.193 CLP	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(36.067)	(1,25)
1.505.238 US$	2.066.679 CAD	18.01.2024	Standard Chartered Bank	2	(56.496)	(1,96)
3.461.914 US$	3.237.047 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	4	(105.052)	(3,65)
74 US$	534 CNY	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(1)	(0,00)
1.509.291 US$	1.237.899 £	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(62.353)	(2,16)
6.873.090 US$	10.552.845 AUD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	5	(299.811)	(10,40)
724.948 US$	7.999.840 NOK	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(57.076)	(1,98)
1.131.122 US$	19.803.634 MXN	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	4	(31.901)	(1,11)
153.107 US$	54.632.541 HUF	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(4.014)	(0,14)
253.972 US$	238.057 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(8.288)	(0,29)
1.057.165 US$	153.949.540 ¥	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(33.894)	(1,18)
219.166 US$	355.449 NZD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(5.338)	(0,19)
2.087.488 US$	1.870.099 CHF	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(124.923)	(4,33)
1.478.723 US$	16.353.929 SEK	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(131.246)	(4,55)
2.081.375 US$	1.951.535 €	18.01.2024	UBS AG	3	(68.513)	(2,38)
303.036 US$	110.559.501 HUF	18.01.2024	UBS AG	1	(14.279)	(0,50)

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (160,09 %) (31. Dezember 2022: (14,06 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettover-mögens
6.118.548 US$	5.415.102 CHF	18.01.2024	UBS AG	4	(294.810)	(10,23)
98.474 US$	1.031.750 SEK	18.01.2024	UBS AG	1	(3.591)	(0,12)
1.341.901 US$	197.466.755 ¥	18.01.2024	UBS AG	1	(56.227)	(1,95)
632.555 US$	14.697.998 CZK	18.01.2024	UBS AG	2	(22.394)	(0,78)
630.566 US$	1.044.028 NZD	18.01.2024	UBS AG	1	(27.594)	(0,96)
1.403.211 US$	15.425.057 NOK	18.01.2024	UBS AG	2	(105.180)	(3,65)
2.554.844 US$	4.008.639 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(164.542)	(5,71)
947.509 US$	890.515 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(33.304)	(1,16)
623.334 US$	512.453 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(27.139)	(0,94)
1.035.603 US$	1.713.257 NZD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(44.521)	(1,54)
Abgesicherte Klassen GBP						
2.754 €	2.408 £	18.01.2024	Deutsche Bank AG	4	(23)	(0,00)
1.283 €	1.124 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(13)	(0,00)
2.416 €	2.101 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(8)	(0,00)
171.899 €	150.817 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(2.056)	(0,07)
134 £	156 €	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(1)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SEK						
201.593 €	2.323.758 SEK	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(7.148)	(0,25)
38.796 €	443.227 SEK	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(1.019)	(0,04)
5.782.267 €	66.359.416 SEK	18.01.2024	Westpac Banking Corp	62	(178.691)	(6,20)
516 SEK	48 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	0	(0,00)
Abgesicherte Klassen USD						
1.145 €	1.269 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
621 US$	563 €	18.01.2024	Deutsche Bank AG	1	(1)	(0,00)
1.947 US$	1.834 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(72)	(0,00)
1.023 US$	951 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(25)	(0,00)
95.600 US$	89.717 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(3.227)	(0,10)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞]					**(4.613.695)**	**(160,09)**

	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(4.613.695)**	**(160,09)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**2.768.142**	**96,06**
Sonstiges Nettovermögen	**113.664**	**3,94**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**2.881.806**	**100,00**

Macro Opportunities FX - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse		EUR	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	347.166	4,60
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	2.407.376	31,89
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	13.600	0,18
Anlagen insgesamt		**2.768.142**	**36,67**

Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 91,99 % (31. Dezember 2022: 92,48 %)		
	Kanadischer Dollar		
21.648	First Quantum Minerals Ltd	178.129	0,11
12.556	Magna International Inc	745.495	0,45
	Kanadischer Dollar insgesamt	**923.624**	**0,56**
	Chinesischer Yuan Renminbi		
32.300	StarPower Semiconductor Ltd Class A	821.040	0,50
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt	**821.040**	**0,50**
	Euro		
19.540	BE Semiconductor Industries NV	2.945.254	1,79
17.763	Infineon Technologies AG	741.708	0,45
23.781	Schneider Electric SE	4.775.303	2,91
	Euro insgesamt	**8.462.265**	**5,15**
	Hongkong-Dollar		
48.200	Baidu Inc Class A	716.653	0,43
37.000	BYD Co Ltd - H Shares	1.015.912	0,62
69.572	JD.com Inc Class A	1.002.344	0,61
103.236	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	936.700	0,57
	Hongkong-Dollar insgesamt	**3.671.609**	**2,23**
	Japanischer Yen		
106.842	Murata Manufacturing Co Ltd	2.268.251	1,38
37.541	Taiyo Yuden Co Ltd	993.247	0,60
	Japanischer Yen insgesamt	**3.261.498**	**1,98**
	Neuer taiwanesischer Dollar		
50.000	MediaTek Inc	1.653.606	1,01
	Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt	**1.653.606**	**1,01**
	Südkoreanischer Won		
1.839	LG Chem Ltd	707.323	0,43
2.068	LG Energy Solution Ltd	682.472	0,42
	Südkoreanischer Won insgesamt	**1.389.795**	**0,85**
	Schwedische Krone		
101.682	Epiroc AB Class A	2.040.128	1,24
	Schwedische Krone insgesamt	**2.040.128**	**1,24**

Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 91,99 % (31. Dezember 2022: 92,48 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar		
17.596	Advanced Micro Devices Inc	2.593.826	1,58
7.640	Air Products & Chemicals Inc	2.091.832	1,27
4.135	Albemarle Corp	597.425	0,36
9.658	Alphabet Inc Class A	1.349.126	0,82
28.438	Altair Engineering Inc Class A	2.393.058	1,46
13.470	Amazon.com Inc	2.046.632	1,25
24.402	Ambarella Inc	1.495.599	0,91
64.190	Amphenol Corp Class A	6.363.155	3,87
22.859	Analog Devices Inc	4.538.883	2,76
12.473	ANSYS Inc	4.526.202	2,75
23.762	Applied Materials Inc	3.851.107	2,34
32.399	Aptiv Plc	2.906.838	1,77
5.958	ASML Holding NV	4.509.729	2,74
11.311	Autodesk Inc	2.754.002	1,68
118.338	Ballard Power Systems Inc	437.851	0,27
19.352	Cadence Design Systems Inc	5.270.904	3,21
16.714	Caterpillar Inc	4.941.828	3,01
8.962	Deere & Co	3.583.635	2,18
67.199	General Motors Co	2.413.788	1,47
92.071	Gentex Corp	3.007.039	1,83
13.861	Globalfoundries Inc	839.977	0,51
15.881	Keysight Technologies Inc	2.526.508	1,54
3.760	Lam Research Corp	2.945.058	1,79
38.121	Lattice Semiconductor Corp	2.629.968	1,60
12.703	Linde Plc	5.217.249	3,17
15.884	Micron Technology Inc	1.355.541	0,82
17.735	Mobileye Global Inc Class A	768.280	0,47
6.518	Monolithic Power Systems Inc	4.111.424	2,50
179.324	MP Materials Corp	3.559.581	2,17
29.766	NIO Inc ADR	269.978	0,16
9.752	NVIDIA Corp	4.829.385	2,94
13.894	NXP Semiconductors NV	3.191.174	1,94
29.933	ON Semiconductor Corp	2.500.304	1,52
9.271	Qorvo Inc	1.044.007	0,64
50.332	Rambus Inc	3.435.159	2,09
2.509	S&P Global Inc	1.105.265	0,67
42.075	Sensata Technologies Holding Plc	1.580.758	0,96
14.810	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	1.540.240	0,94

Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 91,99 % (31. Dezember 2022: 92,48 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
32.080	TE Connectivity Ltd	4.507.240	2,74
14.159	Tesla Inc	3.518.228	2,14
12.855	Texas Instruments Inc	2.191.263	1,33
23.384	T-Mobile US Inc	3.749.157	2,28
86.499	Trimble Inc	4.601.747	2,80
49.813	Uber Technologies Inc	3.066.986	1,87
5.576	Verisk Analytics Inc Class A	1.331.883	0,81
3.982	Zscaler Inc	882.252	0,54
	US-Dollar insgesamt	**128.971.071**	**78,47**
	Aktien insgesamt *	**151.194.636**	**91,99**
	Immobilienaktiengesellschaften 0,99 % (31. Dezember 2022: 1,03 %)		
	US-Dollar		
12.151	Prologis Inc	1.619.728	0,99
	Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *	**1.619.728**	**0,99**
	Anlagen insgesamt	**152.814.364**	**92,98**

Devisenterminkontrakte 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,20 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
22.420 €	24.272 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	510	0,00
262.816 €	280.221 US$	18.01.2024	UBS AG	10	10.281	0,01
258.617 €	275.862 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	15	9.998	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**20.789**	**0,01**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**152.835.153**	**92,99**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
3.842 €	4.257 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(10)	(0,00)
23.490 US$	21.992 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	(820)	(0,00)
1.430 US$	1.335 €	18.01.2024	UBS AG	1	(45)	(0,00)
345.164 US$	320.857 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	13	(9.490)	(0,01)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(10.365)**	**(0,01)**

Next Generation Mobility - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(10.365)**	**(0,01)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**152.824.788**	**92,98**
Sonstiges Nettovermögen	**11.531.277**	**7,02**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**164.356.065**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	152.814.364	92,43
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	10.424	0,01
Anlagen insgesamt		**152.824.788**	**92,44**

Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 94,58 % (31. Dezember 2022: 94,00 %)		
	Chinesischer Yuan Renminbi		
67.020	Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A	291.964	1,48
	Chinesischer Yuan Renminbi insgesamt	**291.964**	**1,48**
	Euro		
3.321	Airbus SE	512.789	2,60
14.835	Avio SpA	138.638	0,70
10.331	AXA SA	336.544	1,70
39.419	Eutelsat Communications SACA	185.063	0,94
3.528	Safran SA	621.448	3,15
2.396	Thales SA	354.531	1,79
	Euro insgesamt	**2.149.013**	**10,88**
	Japanischer Yen		
16.200	Mitsubishi Electric Corp	229.705	1,16
7.200	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	420.877	2,13
5.700	NEC Corp	337.601	1,71
33.700	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	166.850	0,85
36.300	Toray Industries Inc	188.761	0,96
	Japanischer Yen insgesamt	**1.343.794**	**6,81**
	Neuer taiwanesischer Dollar		
36.000	Universal Microwave Technology Inc	190.613	0,96
	Neuer taiwanesischer Dollar insgesamt	**190.613**	**0,96**
	Britisches Pfund		
27.769	BAE Systems Plc	393.116	1,99
204.682	Spirent Communications Plc	321.725	1,63
	Britisches Pfund insgesamt	**714.841**	**3,62**
	Singapur-Dollar		
200.500	Singapore Technologies Engineering Ltd	591.271	2,99
	Singapur-Dollar insgesamt	**591.271**	**2,99**
	Südkoreanischer Won		
2.904	Hanwha Aerospace Co Ltd	280.151	1,42
13.135	Intellian Technologies Inc	736.142	3,73
	Südkoreanischer Won insgesamt	**1.016.293**	**5,15**
	US-Dollar		
3.713	Advanced Micro Devices Inc	547.333	2,77

Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 94,58 % (31. Dezember 2022: 94,00 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
3.043	Amazon.com Inc	462.353	2,34
954	Analog Devices Inc	189.426	0,96
1.067	ANSYS Inc	387.193	1,96
387	ASML Holding NV	292.928	1,48
3.554	Boeing Co	926.386	4,69
901	CACI International Inc Class A	291.798	1,48
683	Crowdstrike Holdings Inc Class A	174.384	0,88
1.217	Deere & Co	486.642	2,46
3.800	Hexcel Corp	280.250	1,42
10.133	Iridium Communications Inc	417.074	2,11
734	Jacobs Solutions Inc	95.273	0,48
3.398	Keysight Technologies Inc	540.588	2,74
13.625	Kratos Defense & Security Solutions Inc	276.451	1,40
779	Lockheed Martin Corp	353.074	1,79
1.007	Microsoft Corp	378.672	1,92
1.340	Motorola Solutions Inc	419.541	2,13
4.816	NV5 Global Inc	535.154	2,71
1.075	NVIDIA Corp	532.361	2,70
2.356	Okta Inc Class A	213.289	1,08
1.118	Palo Alto Networks Inc	329.676	1,67
134.323	Planet Labs PBC	331.778	1,68
3.972	QUALCOMM Inc	574.470	2,91
147.626	Rocket Lab USA Inc	816.372	4,13
1.993	Teledyne Technologies Inc	889.456	4,51
507	TransDigm Group Inc	512.881	2,60
8.888	Trimble Inc	472.842	2,40
4.593	Uber Technologies Inc	282.791	1,43
43.963	Virgin Galactic Holdings Inc	107.709	0,55
1.168	Zscaler Inc	258.782	1,31
	US-Dollar insgesamt	**12.376.927**	**62,69**
	Aktien insgesamt *	**18.674.716**	**94,58**
	Anlagen insgesamt	**18.674.716**	**94,58**

Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**18.674.716**	**94,58**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**18.674.716**	**94,58**
Sonstiges Nettovermögen	**1.069.214**	**5,42**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**19.743.930**	**100,00**

Next Generation Space Economy - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtvermögens
* Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	18.674.716	94,36
Anlagen insgesamt	**18.674.716**	**94,36**

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Schatzwechsel 3,90 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
	US-Dollar				
2.500.000	United States Treasury Bill	0,00 %	11.01.2024	2.496.736	3,90
	Schatzwechsel insgesamt **			**2.496.736**	**3,90**
	Unternehmensanleihen 71,46 % (31. Dezember 2022: 83,65 %)				
	US-Dollar				
200.000	Adani Green Energy Ltd*	4,38 %	08.09.2024	193.241	0,30
700.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ*	6,25 %	10.12.2024	692.578	1,08
200.000	AIA Group Ltd*	2,70 %	29.12.2049	182.337	0,29
200.000	AIA Group Ltd*	3,20 %	16.09.2040	151.942	0,24
400.000	AIA Group Ltd**	4,95 %	04.04.2033	403.060	0,63
200.000	AIA Group Ltd*	5,63 %	25.10.2027	206.414	0,32
200.000	Alibaba Group Holding Ltd*	2,13 %	09.02.2031	165.852	0,26
300.000	Alibaba Group Holding Ltd*	2,70 %	09.02.2041	205.478	0,32
200.000	Alibaba Group Holding Ltd*	3,40 %	06.12.2027	189.767	0,30
200.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,00 %	06.12.2037	172.033	0,27
200.000	Alibaba Group Holding Ltd*	4,40 %	06.12.2057	163.105	0,26
200.000	Axiata SPV2 Bhd**	2,16 %	19.08.2030	170.346	0,27
400.000	Axis Bank Ltd*	4,10 %	29.12.2049	365.433	0,57
200.000	Baidu Inc**	2,38 %	23.08.2031	165.757	0,26
400.000	Bangkok Bank PCL**	3,73 %	25.09.2034	355.844	0,56
200.000	Bangkok Bank PCL*	4,30 %	15.06.2027	196.095	0,31
200.000	Bangkok Bank PCL**	5,00 %	29.12.2049	191.664	0,30
400.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**	3,75 %	30.03.2026	382.379	0,60
200.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	4,30 %	29.12.2049	177.706	0,28
600.000	Bank of China Ltd**	5,00 %	13.11.2024	596.865	0,93
250.000	Bank of East Asia Ltd*	4,00 %	29.05.2030	235.836	0,37
200.000	BOC Aviation Ltd**	1,75 %	21.01.2026	187.113	0,29
200.000	BOC Aviation Ltd*	2,63 %	17.09.2030	172.691	0,27
200.000	BOC Aviation Ltd*	3,00 %	11.09.2029	180.011	0,28
200.000	BOC Aviation Ltd**	3,50 %	10.10.2024	197.180	0,31
200.000	BOC Aviation Ltd*	4,50 %	23.05.2028	196.350	0,31
200.000	BOC Aviation USA Corp*	1,63 %	29.04.2024	197.483	0,31
200.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00 %	29.12.2049	172.920	0,27
200.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd*	1,80 %	22.07.2026	185.173	0,29
400.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd*	1,99 %	21.07.2025	381.249	0,60
400.000	CDBL Funding 2*	2,00 %	04.03.2026	376.191	0,59
200.000	Celestial Miles Ltd*	5,75 %	29.12.2049	199.600	0,31
200.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd*	4,75 %	08.02.2028	195.664	0,31
400.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd**	4,75 %	21.02.2029	388.612	0,61

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 71,46 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
300.000	China CITIC Bank International Ltd*	6,00 %	05.12.2033	307.518	0,48
600.000	China Construction Bank Corp*	2,45 %	24.06.2030	574.605	0,90
400.000	China Construction Bank Corp*	4,50 %	31.05.2026	397.795	0,62
200.000	China Hongqiao Group Ltd*	6,25 %	08.06.2024	198.770	0,31
400.000	China SCE Group Holdings Ltd**	7,00 %	02.05.2025	25.200	0,04
200.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*	5,49 %	01.03.2026	201.893	0,32
300.000	CK Hutchison International 17 II Ltd**	3,25 %	29.09.2027	284.505	0,44
200.000	CK Hutchison International 21 Ltd*	2,50 %	15.04.2031	171.577	0,27
200.000	CK Hutchison International 23 Ltd**	4,75 %	21.04.2028	200.395	0,31
390.000	CK Hutchison International 23 Ltd**	4,88 %	21.04.2033	391.577	0,61
300.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88 %	12.08.2025	284.464	0,44
200.000	CMHI Finance BVI Co Ltd*	5,00 %	06.08.2028	203.515	0,32
200.000	Contemporary Ruiding Development Ltd*	2,63 %	17.09.2030	171.403	0,27
178.250	Continuum Energy Levanter Pte Ltd**	4,50 %	09.02.2027	167.754	0,26
200.000	DBS Group Holdings Ltd**	1,82 %	10.03.2031	185.518	0,29
200.000	DBS Group Holdings Ltd*	3,30 %	29.12.2049	193.178	0,30
300.000	DBS Group Holdings Ltd**	5,48 %	12.09.2025	303.651	0,47
800.000	Dua Capital Ltd*	2,78 %	11.05.2031	697.587	1,09
200.000	Elect Global Investments Ltd*	4,10 %	29.12.2049	176.000	0,28
800.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38 %	12.05.2026	750.713	1,17
400.000	ENN Energy Holdings Ltd**	2,63 %	17.09.2030	342.816	0,54
200.000	Fortune Star BVI Ltd*	5,95 %	19.10.2025	166.737	0,26
200.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25 %	23.07.2029	130.206	0,20
400.000	GC Treasury Center Co Ltd*	4,40 %	30.03.2032	365.594	0,57
200.000	Globe Telecom Inc*	4,20 %	29.12.2049	189.356	0,30
370.000	Greenko Dutch BV**	3,85 %	29.03.2026	345.367	0,54
360.000	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	325.440	0,50
200.000	Greenko Solar Mauritius Ltd*	5,95 %	29.07.2026	193.900	0,30
200.000	Hana Bank*	3,25 %	30.03.2027	191.297	0,30
200.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd**	3,38 %	04.02.2032	184.496	0,29
400.000	HDFC Bank Ltd**	3,70 %	29.12.2049	365.019	0,57
200.000	HKT Capital No 6 Ltd**	3,00 %	18.01.2032	172.411	0,27
200.000	Horse Gallop Finance Ltd**	1,10 %	26.07.2024	195.379	0,31
200.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,75 %	29.05.2024	197.302	0,31
500.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	4,50 %	29.05.2029	443.425	0,69
650.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	644.313	1,01
200.000	Hyundai Capital America**	5,50 %	30.03.2026	201.122	0,31

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 71,46 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
400.000	Hyundai Capital America**	5,60 %	30.03.2028	406.223	0,64
200.000	Hyundai Capital America**	5,68 %	26.06.2028	203.999	0,32
200.000	Indian Railway Finance Corp Ltd*	2,80 %	10.02.2031	172.329	0,27
200.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT**	3,40 %	09.06.2031	173.294	0,27
200.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT**	3,54 %	27.04.2032	173.230	0,27
600.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd**	4,88 %	21.09.2025	595.320	0,93
200.000	Inventive Global Investments Ltd*	1,10 %	01.09.2024	194.545	0,30
400.000	JD.com Inc**	3,38 %	14.01.2030	361.984	0,57
402.500	JSW Hydro Energy Ltd*	4,13 %	18.05.2031	351.135	0,55
500.000	Kasikornbank PCL*	3,34 %	02.10.2031	460.180	0,72
200.000	Kasikornbank PCL*	5,46 %	07.03.2028	204.012	0,32
200.000	Khazanah Capital Ltd**	4,88 %	01.06.2033	201.092	0,31
400.000	Kookmin Bank**	2,50 %	04.11.2030	333.370	0,52
200.000	Krung Thai Bank PCL**	4,40 %	29.12.2049	186.020	0,29
200.000	KT Corp*	4,00 %	08.08.2025	196.708	0,31
200.000	Kyobo Life Insurance Co Ltd*	5,90 %	15.06.2052	198.600	0,31
200.000	Lenovo Group Ltd*	3,42 %	02.11.2030	176.744	0,28
473.000	Lenovo Group Ltd*	5,83 %	27.01.2028	482.739	0,76
200.000	Lenovo Group Ltd*	6,54 %	27.07.2032	213.435	0,33
400.000	LG Chem Ltd*	2,38 %	07.07.2031	331.350	0,52
200.000	LG Energy Solution Ltd**	5,75 %	25.09.2028	206.295	0,32
200.000	Link Finance Cayman 2009 Ltd*	2,75 %	19.01.2032	169.573	0,27
200.000	Longfor Group Holdings Ltd**	3,95 %	16.09.2029	92.201	0,14
800.000	Medco Bell Pte Ltd**	6,38 %	30.01.2027	762.250	1,19
200.000	Medco Oak Tree Pte Ltd**	7,38 %	14.05.2026	198.832	0,31
300.000	Meituan*	3,05 %	28.10.2030	253.434	0,40
200.000	Metropolitan Bank & Trust Co**	2,13 %	15.01.2026	187.335	0,29
200.000	MTR Corp Ltd**	1,63 %	19.08.2030	167.273	0,26
400.000	Network i2i Ltd*	5,65 %	29.12.2049	396.172	0,62
400.000	NWD Finance BVI Ltd*	5,25 %	29.12.2049	265.283	0,41
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**	1,83 %	10.09.2030	188.208	0,29
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	4,60 %	15.06.2032	197.664	0,31
500.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	493.390	0,77
1.900.000	Pertamina Persero PT*	6,50 %	27.05.2041	2.100.912	3,29
200.000	Philippine National Bank**	3,28 %	27.09.2024	195.650	0,31
300.000	Power Finance Corp Ltd*	3,35 %	16.05.2031	264.590	0,41
300.000	Power Finance Corp Ltd*	3,95 %	23.04.2030	277.774	0,43
700.000	Prudential Funding Asia Plc*	2,95 %	03.11.2033	616.486	0,96

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 71,46 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
200.000	PSA Treasury Pte Ltd*	2,25 %	30.04.2030	174.613	0,27
200.000	REC Ltd*	2,25 %	01.09.2026	184.914	0,29
200.000	REC Ltd**	5,63 %	11.04.2028	203.293	0,32
250.000	Reliance Industries Ltd*	2,88 %	12.01.2032	214.370	0,34
500.000	Reliance Industries Ltd*	3,63 %	12.01.2052	367.438	0,57
300.000	Reliance Industries Ltd*	4,13 %	28.01.2025	296.352	0,46
800.000	ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries**	4,50 %	14.07.2028	711.686	1,11
200.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd**	5,20 %	12.01.2026	52.148	0,08
200.000	SF Holding Investment 2021 Ltd*	2,38 %	17.11.2026	185.892	0,29
422.000	SF Holding Investment 2021 Ltd*	3,13 %	17.11.2031	366.680	0,57
300.000	Shinhan Bank Co Ltd**	3,88 %	24.03.2026	290.026	0,45
400.000	Shinhan Bank Co Ltd*	4,38 %	13.04.2032	370.846	0,58
200.000	Shinhan Bank Co Ltd**	4,50 %	12.04.2028	198.516	0,31
200.000	Shinhan Financial Group Co Ltd*	3,34 %	05.02.2030	194.910	0,30
325.000	Shinhan Financial Group Co Ltd**	5,00 %	24.07.2028	325.095	0,51
500.000	Shriram Finance Ltd*	4,40 %	13.03.2024	496.960	0,78
200.000	Singapore Telecommunications Ltd**	7,38 %	01.12.2031	235.043	0,37
200.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd**	4,75 %	05.08.2029	13.500	0,02
400.000	SK Battery America Inc**	2,13 %	26.01.2026	369.944	0,58
400.000	SK Hynix Inc*	2,38 %	19.01.2031	324.685	0,51
200.000	SK Hynix Inc*	6,38 %	17.01.2028	206.717	0,32
200.000	SK Hynix Inc*	6,50 %	17.01.2033	211.311	0,33
200.000	SK On Co Ltd**	5,38 %	11.05.2026	201.383	0,32
400.000	Standard Chartered Plc*	1,46 %	14.01.2027	366.669	0,57
400.000	Standard Chartered Plc*	4,30 %	29.12.2049	326.208	0,51
200.000	Standard Chartered Plc**	4,75 %	29.12.2049	163.218	0,26
200.000	Standard Chartered Plc*	6,19 %	06.07.2027	203.472	0,32
500.000	Standard Chartered Plc*	6,30 %	06.07.2034	525.454	0,82
600.000	Standard Chartered Plc*	6,30 %	09.01.2029	615.637	0,96
200.000	Star Energy Geothermal Darajat II/Star Energy Geothermal Salak*	4,85 %	14.10.2038	183.417	0,29
162.160	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd**	6,75 %	24.04.2033	162.240	0,25
400.000	State Bank of India*	4,88 %	05.05.2028	399.914	0,63
200.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd*	2,75 %	13.05.2030	174.226	0,27
200.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd**	3,75 %	25.02.2029	188.851	0,30
500.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24 %	03.06.2050	333.853	0,52
200.000	Tencent Holdings Ltd*	3,60 %	19.01.2028	190.409	0,30
200.000	Tencent Holdings Ltd**	3,68 %	22.04.2041	157.441	0,25
200.000	Tencent Holdings Ltd*	3,98 %	11.04.2029	190.418	0,30

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 71,46 % (31. Dezember 2022: 83,65 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
400.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75 %	18.06.2050	282.213	0,44
500.000	TSMC Arizona Corp*	1,75 %	25.10.2026	461.090	0,72
400.000	TSMC Arizona Corp*	2,50 %	25.10.2031	344.571	0,54
500.000	TSMC Global Ltd*	2,25 %	23.04.2031	426.140	0,67
200.000	United Overseas Bank Ltd*	1,75 %	16.03.2031	184.660	0,29
200.000	United Overseas Bank Ltd*	2,00 %	14.10.2031	182.303	0,29
600.000	United Overseas Bank Ltd*	3,86 %	07.10.2032	574.063	0,90
200.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd*	3,98 %	09.11.2027	134.710	0,21
600.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95 %	11.03.2025	446.724	0,70
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	176.756	0,28
200.000	Woori Bank*	4,75 %	30.04.2024	199.362	0,31
200.000	Yanlord Land HK Co Ltd**	5,13 %	20.05.2026	116.484	0,18
	Unternehmensanleihen insgesamt			**45.692.223**	**71,46**
	Staatsanleihen 18,81 % (31. Dezember 2022: 9,67 %)				
	Euro				
900.000	Indonesia Government International Bond	1,10 %	12.03.2033	789.141	1,23
1.108.000	Indonesia Government International Bond	1,40 %	30.10.2031	1.040.635	1,63
400.000	Philippine Government International Bond	1,20 %	28.04.2033	355.787	0,56
	Euro insgesamt			**2.185.563**	**3,42**
	US-Dollar				
200.000	Airport Authority	2,10 %	29.12.2049	185.303	0,29
200.000	Airport Authority	2,40 %	29.12.2049	177.654	0,28
400.000	Airport Authority	3,25 %	12.01.2052	308.336	0,48
300.000	Airport Authority	4,88 %	12.01.2033	307.876	0,48
200.000	Export-Import Bank of India	2,25 %	13.01.2031	167.634	0,26
200.000	Export-Import Bank of Korea	4,50 %	15.09.2032	199.915	0,31
600.000	Export-Import Bank of Korea	5,00 %	11.01.2028	611.523	0,96
750.000	Indonesia Government International Bond	4,85 %	11.01.2033	764.766	1,20
95.000	Indonesia Government International Bond	7,75 %	17.01.2038	122.102	0,19
1.100.000	Indonesia Government International Bond	8,50 %	12.10.2035	1.465.750	2,29
342.000	Industrial Bank of Korea	5,38 %	04.10.2028	353.339	0,55
200.000	Korea Development Bank	4,38 %	15.02.2028	199.136	0,31
200.000	Korea Development Bank	4,38 %	15.02.2033	196.332	0,31
200.000	Korea Gas Corp	2,88 %	16.07.2029	183.008	0,29
200.000	Korea Gas Corp	3,88 %	13.07.2027	194.835	0,31
300.000	Korea Gas Corp	4,88 %	05.07.2028	302.979	0,47

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 18,81 % (31. Dezember 2022: 9,67 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
200.000	Korea Housing Finance Corp	4,63 %	24.02.2028	199.757	0,31
450.000	Korea Land & Housing Corp	5,75 %	06.10.2025	455.328	0,71
200.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp	1,75 %	15.04.2026	184.811	0,29
400.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp	5,38 %	11.05.2028	404.394	0,63
650.000	Mongolia Government International Bond	8,65 %	19.01.2028	682.050	1,07
500.000	Philippine Government International Bond	6,38 %	23.10.2034	567.795	0,89
200.000	Sri Lanka Government International Bond	5,75 %	18.04.2023	102.875	0,16
200.000	Sri Lanka Government International Bond	5,88 %	25.07.2024	105.900	0,17
200.000	Sri Lanka Government International Bond	6,35 %	28.06.2024	101.861	0,16
1.000.000	Sri Lanka Government International Bond	6,83 %	18.07.2026	514.396	0,80
800.000	Sri Lanka Government International Bond	6,85 %	14.03.2024	407.380	0,64
720.000	Sri Lanka Government International Bond	6,85 %	03.11.2025	372.598	0,58
	US-Dollar insgesamt			**9.839.633**	**15,39**
	Staatsanleihen insgesamt *			**12.025.196**	**18,81**
	Anlagen insgesamt			**60.214.155**	**94,17**

Devisenterminkontrakte 0,20 % (31. Dezember 2022: 0,16 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
4.843.308.714 IDR	306.976 US$	07.02.2024	Standard Chartered Bank	1	7.164	0,01
25.391.445 INR	304.372 US$	08.02.2024	Citibank NA	1	272	0,00
60.196.663 KRW	46.083 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	553	0,00
415.499.493 KRW	315.322 US$	16.01.2024	Standard Chartered Bank	1	5.244	0,01
817.357.899 KRW	626.191 US$	20.03.2024	UBS AG	1	7.037	0,01
1.434.521 MYR	307.323 US$	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	5.594	0,01
1.447.850 MYR	306.469 US$	23.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	9.639	0,01
2.874.947 MYR	620.069 US$	07.03.2024	Standard Chartered Bank	1	9.840	0,02
17.227.946 PHP	307.576 US$	06.02.2024	Morgan Stanley	1	3.429	0,01
416.971 SGD	306.582 US$	22.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	9.816	0,02
11.121.999 THB	311.200 US$	16.01.2024	BNP Paribas	1	15.028	0,02
40.110 THB	1.151 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	32	0,00
40.111 THB	1.153 US$	20.03.2024	Goldman Sachs International	1	30	0,00
21.835.494 THB	622.484 US$	08.01.2024	Goldman Sachs International	1	17.498	0,03
19.649.022 TWD	617.888 US$	12.01.2024	Citibank NA	1	26.830	0,04
9.804.377 TWD	312.969 US$	08.01.2024	Goldman Sachs International	1	8.007	0,01
79.042 US$	101.151.334 KRW	20.03.2024	Citibank NA	1	677	0,00
327.152 US$	423.563.202 KRW	16.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	365	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**127.055**	**0,20**

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 0,40 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettovermögens
2	South Korea 10-Year Bond Future March 2024	2.376	0,00
28	South Korea 3-Year Bond Future March 2024	6.957	0,01
22	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	246.525	0,39
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**255.858**	**0,40**

Zinsswap-Kontrakte 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Nominalwert		Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettovermögens
CNY	4.000.000	11.12.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,25 %	7D CNRR	408	0,00
MYR	3.947.651	20.12.2025	Goldman Sachs International	(Zahlung)	3,50 %	3M KLIBOR	167	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten ∞							**575**	**0,00**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**60.597.643**	**94,77**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2022: (0,39 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
4.444.712 CNH	624.696 US$	10.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(167)	(0,00)
303.185 US$	413.233 SGD	22.01.2024	Citibank NA	1	(10.376)	(0,02)
61 US$	943.992 IDR	20.03.2024	Citibank NA	1	0	(0,00)
15.818 US$	112.327 CNH	20.03.2024	Citibank NA	2	(41)	(0,00)
301.188 US$	1.426.727 MYR	23.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(10.309)	(0,02)
650.052 US$	4.679.539 CNY	20.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(9.333)	(0,01)
2.057.426 US$	1.898.111 €	20.03.2024	Morgan Stanley	2	(45.904)	(0,07)
329.691 US$	11.501.334 THB	16.01.2024	Morgan Stanley	1	(7.664)	(0,01)
612.078 US$	4.462.403 CNY	10.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(14.937)	(0,02)
615.648 US$	19.709.861 TWD	12.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(31.066)	(0,05)
324.864 US$	10.075.769 TWD	08.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(4.997)	(0,01)
47.872 US$	62.483.796 KRW	20.03.2024	UBS AG	2	(536)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(135.330)**	**(0,21)**

Responsible Asian Debt – Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte (0,20 %) (31. Dezember 2022: (0,02 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
(14)	Euro-Bund Future March 2024	(76.950)	(0,12)
(16)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	(51.163)	(0,08)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(128.113)**	**(0,20)**

Zinsswap-Kontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
INR	62.801.395	19.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	6,21 %	1D MIBOR	(21)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten ∞							**(21)**	**(0,00)**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

[1]Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(263.464)**	**(0,41)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**60.334.179**	**94,36**
Sonstiges Nettovermögen	**3.607.685**	**5,64**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**63.941.864**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	43.291.945	67,34
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	16.922.210	26,32
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	127.745	0,20
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(7.721)	(0,01)
Anlagen insgesamt		**60.334.179**	**93,85**

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Schatzwechsel 1,36 % (31. Dezember 2022: 1,00 %)				
	US-Dollar				
55.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	23.05.2024	53.894.704	1,36
	Schatzwechsel insgesamt **			**53.894.704**	**1,36**
	Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %)				
	Euro				
15.300.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance Plc*	7,13 %	19.07.2026	8.023.480	0,20
2.000.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara*	2,88 %	25.10.2025	2.172.045	0,06
	Euro insgesamt			**10.195.525**	**0,26**
	US-Dollar				
21.380.000	ABQ Finance Ltd*	1,88 %	08.09.2025	20.039.816	0,51
12.477.000	ABQ Finance Ltd*	2,00 %	06.07.2026	11.460.998	0,29
9.283.000	ABQ Finance Ltd*	3,13 %	24.09.2024	9.116.983	0,23
12.926.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	3,50 %	31.03.2027	12.316.694	0,31
5.370.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	4,50 %	14.09.2027	5.284.375	0,13
10.000.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	5,38 %	18.07.2028	10.158.510	0,26
5.799.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	5,50 %	12.01.2029	5.918.941	0,15
6.713.000	Abu Dhabi National Energy Co PJSC*	4,38 %	24.01.2029	6.682.187	0,17
4.324.000	Access Bank Plc*	6,13 %	21.09.2026	3.903.059	0,10
6.409.000	Adani Green Energy Ltd*	4,38 %	08.09.2024	6.192.402	0,16
14.357.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy*	6,25 %	10.12.2024	14.204.768	0,36
496.000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd**	3,38 %	24.07.2024	486.436	0,01
7.758.000	Africa Finance Corp*	3,88 %	13.04.2024	7.704.803	0,19
8.509.000	African Export-Import Bank*	2,63 %	17.05.2026	7.869.123	0,20
7.500.000	African Export-Import Bank*	4,13 %	20.06.2024	7.434.675	0,19
3.589.000	AIA Group Ltd*	5,63 %	25.10.2027	3.704.094	0,09
2.000.000	Alibaba Group Holding Ltd*	3,40 %	06.12.2027	1.897.674	0,05
10.941.000	Alsea SAB de CV**	7,75 %	14.12.2026	11.179.426	0,28
5.000.000	Arabian Centres Sukuk II Ltd*	5,63 %	07.10.2026	4.588.500	0,12
6.540.000	AUB Sukuk Ltd*	2,62 %	09.09.2026	6.004.963	0,15
2.119.000	Azul Secured Finance LLP**	11,93 %	28.08.2028	2.194.061	0,06
2.552.000	Baidu Inc**	1,72 %	09.04.2026	2.370.640	0,06
12.828.000	Banco Bradesco SA*	3,20 %	27.01.2025	12.465.495	0,32
10.992.000	Banco Bradesco SA**	4,38 %	18.03.2027	10.690.209	0,27
13.882.000	Banco BTG Pactual SA*	2,75 %	11.01.2026	13.117.783	0,33
7.781.000	Banco BTG Pactual SA*	4,50 %	10.01.2025	7.650.320	0,19
5.800.000	Banco BTG Pactual SA Series JUL*	4,50 %	10.01.2025	5.702.591	0,14
11.000.000	Banco de Bogota SA*	6,25 %	12.05.2026	10.869.478	0,27
10.400.000	Banco de Credito del Peru SA**	2,70 %	11.01.2025	10.101.763	0,26

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
10.245.000	Banco do Brasil SA*	3,25 %	30.09.2026	9.735.038	0,24
13.000.000	Banco Inbursa SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Inbursa*	4,13 %	06.06.2024	12.879.636	0,33
9.000.000	Banco Nacional de Comercio Exterior SNC*	2,72 %	11.08.2031	7.690.299	0,19
6.297.000	Banco Santander Chile**	2,70 %	10.01.2025	6.129.153	0,15
17.442.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand**	5,38 %	17.04.2025	17.424.605	0,44
8.824.000	Banco Votorantim SA**	4,50 %	24.09.2024	8.678.877	0,22
10.200.000	Bancolombia SA*	6,91 %	18.10.2027	10.202.213	0,26
4.931.000	Bangkok Bank PCL*	4,30 %	15.06.2027	4.834.724	0,12
3.241.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT**	4,75 %	13.05.2025	3.220.793	0,08
9.789.000	Bank Muscat SAOG*	4,75 %	17.03.2026	9.605.061	0,24
3.832.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**	3,75 %	30.03.2026	3.666.387	0,09
2.800.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	5,00 %	27.07.2027	2.614.150	0,07
8.833.000	BBK BSC*	5,50 %	09.07.2024	8.782.617	0,22
5.338.000	Beijing Gas Singapore Capital Corp*	1,88 %	18.01.2025	5.156.607	0,13
5.677.000	Bidvest Group UK Plc*	3,63 %	23.09.2026	5.279.610	0,13
21.303.017	Bioceanico Sovereign Certificate Ltd*	0,00 %	05.06.2034	15.263.793	0,39
17.184.000	Black Sea Trade & Development Bank*	3,50 %	25.06.2024	16.658.909	0,42
8.457.000	BOC Aviation Ltd**	1,75 %	21.01.2026	7.916.989	0,20
3.487.000	BOC Aviation Ltd*	3,25 %	29.04.2025	3.393.840	0,09
200.000	BOC Aviation Ltd**	3,50 %	18.09.2027	190.350	0,00
5.399.000	BOC Aviation Ltd**	4,00 %	25.01.2024	5.393.277	0,14
5.432.000	BOCOM International Blossom Ltd*	1,75 %	28.06.2026	4.997.100	0,13
3.000.000	Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**	10,00 %	15.11.2028	3.135.000	0,08
3.399.000	Boubyan Sukuk Ltd**	2,59 %	18.02.2025	3.290.528	0,08
8.625.000	Boubyan Sukuk Ltd*	3,39 %	29.03.2027	8.238.557	0,21
49.556.000	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais**	5,33 %	15.02.2028	48.829.013	1,23
17.430.000	BSF Finance*	5,50 %	23.11.2027	17.713.238	0,45
25.742.000	CBQ Finance Ltd*	2,00 %	15.09.2025	24.238.152	0,61
24.369.000	CBQ Finance Ltd*	2,00 %	12.05.2026	22.494.036	0,57
4.800.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd*	1,60 %	15.09.2026	4.397.994	0,11
6.549.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd*	1,99 %	21.07.2025	6.244.978	0,16
9.000.000	CDBL Funding 2*	2,00 %	04.03.2026	8.464.301	0,21
7.200.000	Cencosud SA*	4,38 %	17.07.2027	6.951.352	0,18
3.439.000	Centrais Eletricas Brasileiras SA**	3,63 %	04.02.2025	3.330.340	0,08
7.800.000	Central American Bank for Economic Integration*	1,14 %	09.02.2026	7.179.053	0,18
12.476.000	Central American Bank for Economic Integration*	5,00 %	09.02.2026	12.479.803	0,32
4.926.000	Chalco Hong Kong Investment Co Ltd**	1,55 %	28.07.2024	4.818.163	0,12
4.399.000	China Cinda Finance 2015 I Ltd*	4,25 %	23.04.2025	4.326.175	0,11
7.036.000	China Construction Bank Corp*	1,25 %	04.08.2025	6.641.954	0,17

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
2.709.000	China Hongqiao Group Ltd*	6,25 %	08.06.2024	2.690.112	0,07
24.471.000	China Huadian Overseas Development 2018 Ltd*	3,38 %	29.12.2049	23.568.020	0,60
9.108.000	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd*	4,00 %	29.12.2049	9.031.851	0,23
4.090.000	China Overseas Grand Oceans Finance IV Cayman Ltd*	2,45 %	09.02.2026	3.415.150	0,09
6.237.000	CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd*	2,00 %	26.01.2026	5.880.713	0,15
4.600.000	CITIC Ltd**	2,88 %	17.02.2027	4.357.782	0,11
4.303.000	CITIC Securities Finance MTN Co Ltd*	2,00 %	03.06.2025	4.123.726	0,10
9.695.000	CK Hutchison International 23 Ltd**	4,75 %	21.04.2028	9.714.127	0,25
4.000.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,25 %	16.09.2024	3.884.349	0,10
11.236.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88 %	12.08.2025	10.659.344	0,27
2.500.000	CMB International Leasing Management Ltd*	2,00 %	04.02.2026	2.338.625	0,06
12.815.000	CMHI Finance BVI Co Ltd**	4,00 %	01.06.2027	12.541.746	0,32
9.392.000	CNCBINV 1 BVI Ltd*	1,75 %	17.11.2024	9.074.034	0,23
43.930.000	Comision Federal de Electricidad*	4,69 %	15.05.2029	41.389.866	1,05
14.467.000	Commercial Bank of Dubai PSC*	5,32 %	14.06.2028	14.456.859	0,37
6.871.000	Compania de Minas Buenaventura SAA**	5,50 %	23.07.2026	6.565.528	0,17
23.570.000	Corp Andina de Fomento*	1,25 %	26.10.2024	22.795.855	0,58
27.333.000	Corp Andina de Fomento*	2,25 %	08.02.2027	25.051.374	0,63
15.367.000	Corp Andina de Fomento*	6,00 %	26.04.2027	15.899.103	0,40
3.528.000	Credicorp Ltd**	2,75 %	17.06.2025	3.366.801	0,09
3.800.000	CSCIF Asia Ltd*	1,75 %	04.08.2025	3.603.188	0,09
15.200.000	CSN Inova Ventures**	6,75 %	28.01.2028	14.862.723	0,38
2.000.000	DBS Group Holdings Ltd**	5,48 %	12.09.2025	2.024.340	0,05
14.584.000	DIB Sukuk Ltd*	1,96 %	22.06.2026	13.570.508	0,34
6.741.000	DIB Sukuk Ltd*	2,74 %	16.02.2027	6.305.785	0,16
4.758.000	DIB Sukuk Ltd*	2,95 %	20.02.2025	4.619.219	0,12
22.946.000	DIB Sukuk Ltd*	2,95 %	16.01.2026	22.005.879	0,56
12.489.000	DIB Sukuk Ltd*	4,80 %	16.08.2028	12.401.839	0,31
13.584.000	DIB Sukuk Ltd*	5,49 %	30.11.2027	13.857.541	0,35
42.143.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,88 %	23.05.2024	41.699.234	1,05
24.300.000	Ecopetrol SA*	5,38 %	26.06.2026	23.842.591	0,60
20.000.000	Ecopetrol SA**	8,63 %	19.01.2029	21.339.160	0,54
18.300.000	EI Sukuk Co Ltd**	1,83 %	23.09.2025	17.188.367	0,43
5.800.000	EI Sukuk Co Ltd*	2,08 %	02.11.2026	5.331.082	0,13
27.420.000	Emirates Development Bank PJSC*	1,64 %	15.06.2026	25.147.814	0,64
21.200.000	Emirates Development Bank PJSC*	3,52 %	06.03.2024	21.126.394	0,53
9.165.000	Emirates NBD Bank PJSC**	1,64 %	13.01.2026	8.524.092	0,22
10.376.000	Emirates NBD Bank PJSC**	2,63 %	18.02.2025	10.076.341	0,25
7.328.000	Emirates NBD Bank PJSC*	5,63 %	21.10.2027	7.457.083	0,19
9.603.000	Emirates NBD Bank PJSC*	5,88 %	11.10.2028	9.939.489	0,25

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
4.145.000	Endeavour Mining Plc**	5,00 %	14.10.2026	3.841.918	0,10
1.500.000	Energian Israel Finance Ltd**	4,88 %	30.03.2026	1.386.375	0,04
10.800.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38 %	12.05.2026	10.134.627	0,26
11.568.000	Fab Sukuk Co Ltd*	1,41 %	14.01.2026	10.748.118	0,27
8.577.000	Fab Sukuk Co Ltd*	3,88 %	22.01.2024	8.567.874	0,22
15.000.000	First Abu Dhabi Bank PJSC*	4,38 %	24.04.2028	14.735.445	0,37
26.439.000	First Abu Dhabi Bank PJSC*	5,13 %	13.10.2027	26.668.998	0,67
6.633.000	Franshion Brilliant Ltd*	3,20 %	09.04.2026	5.604.358	0,14
11.143.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00 %	15.12.2025	11.435.103	0,29
11.000.000	Geopark Ltd**	5,50 %	17.01.2027	9.749.769	0,25
6.641.500	Greenko Dutch BV**	3,85 %	29.03.2026	6.199.343	0,16
7.790.000	Greenko Wind Projects Mauritius Ltd**	5,50 %	06.04.2025	7.638.095	0,19
16.370.000	Grupo de Inversiones Suramericana SA*	5,50 %	29.04.2026	16.084.083	0,41
30.576.000	Gulf International Bank BSC*	2,38 %	23.09.2025	28.690.928	0,73
4.200.000	Haitong International Securities Group Ltd*	3,13 %	18.05.2025	4.053.588	0,10
8.395.000	Hana Bank*	3,25 %	30.03.2027	8.029.697	0,20
1.551.000	Hengjian International Investment Ltd**	1,88 %	23.06.2025	1.476.765	0,04
13.693.000	Hikma Finance USA LLC*	3,25 %	09.07.2025	13.142.541	0,33
4.995.000	Horse Gallop Finance Ltd*	1,70 %	28.07.2025	4.725.309	0,12
5.000.000	HPHT Finance 19 Ltd**	2,88 %	05.11.2024	4.897.850	0,12
8.250.000	HPHT Finance 21 II Ltd**	1,50 %	17.09.2026	7.522.309	0,19
7.365.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,25 %	13.11.2024	7.144.050	0,18
7.858.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	3,75 %	29.05.2024	7.751.996	0,20
2.400.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	2.379.000	0,06
1.000.000	Hyundai Capital America**	1,65 %	17.09.2026	909.275	0,02
6.100.000	Hyundai Capital America**	2,65 %	10.02.2025	5.922.168	0,15
6.097.000	Hyundai Capital America**	5,50 %	30.03.2026	6.131.205	0,15
9.805.000	Hyundai Capital America**	5,68 %	26.06.2028	10.001.075	0,25
5.000.000	Hyundai Capital America**	5,95 %	21.09.2026	5.087.324	0,13
5.400.000	IHS Holding Ltd**	5,63 %	29.11.2026	4.714.119	0,12
6.200.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00 %	18.09.2027	5.542.552	0,14
4.000.000	Inventive Global Investments Ltd*	1,10 %	01.09.2024	3.890.900	0,10
6.467.000	Israel Discount Bank Ltd**	5,38 %	26.01.2028	6.293.089	0,16
2.031.000	Itau Unibanco Holding SA**	3,25 %	24.01.2025	1.976.659	0,05
7.411.000	JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc**	2,50 %	15.01.2027	6.824.679	0,17
3.996.000	JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co/JBS USA Finance Inc**	5,13 %	01.02.2028	3.976.324	0,10
7.877.000	JSW Steel Ltd**	5,95 %	18.04.2024	7.847.931	0,20
8.439.000	Kallpa Generacion SA*	4,13 %	16.08.2027	8.072.824	0,20
4.081.000	Kasikornbank PCL*	5,46 %	07.03.2028	4.162.865	0,11
13.132.000	KazMunayGas National Co JSC*	4,75 %	19.04.2027	12.797.068	0,32

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
7.000.000	KOC Holding AS*	6,50 %	11.03.2025	6.984.775	0,18
6.079.000	Kookmin Bank*	1,38 %	06.05.2026	5.570.015	0,14
5.500.000	Kosmos Energy Ltd*	7,13 %	04.04.2026	5.248.687	0,13
2.775.000	KT Corp*	4,00 %	08.08.2025	2.729.318	0,07
3.151.000	Legend Fortune Ltd*	1,38 %	02.06.2024	3.099.746	0,08
3.500.000	Lenovo Group Ltd*	5,83 %	27.01.2028	3.572.066	0,09
2.000.000	Levc Finance Ltd**	1,38 %	25.03.2024	1.981.230	0,05
17.134.226	Leviathan Bond Ltd*	6,13 %	30.06.2025	16.656.181	0,42
2.939.000	LG Energy Solution Ltd**	5,75 %	25.09.2028	3.031.509	0,08
3.200.000	Longfor Group Holdings Ltd*	4,50 %	16.01.2028	1.668.083	0,04
15.456.000	Mashreqbank PSC*	4,25 %	26.02.2024	15.443.172	0,39
20.500.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	2,50 %	07.11.2024	20.000.518	0,51
6.800.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	3,00 %	19.04.2024	6.749.428	0,17
14.708.000	MDGH GMTN RSC Ltd*	3,00 %	28.03.2027	13.958.260	0,35
4.417.000	Medco Bell Pte Ltd**	6,38 %	30.01.2027	4.208.570	0,11
10.200.000	MEGlobal Canada ULC*	5,00 %	18.05.2025	10.097.490	0,26
4.265.000	Meituan*	2,13 %	28.10.2025	4.014.272	0,10
4.638.000	Melco Resorts Finance Ltd**	4,88 %	06.06.2025	4.502.663	0,11
8.678.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,25 %	26.04.2026	8.373.012	0,21
2.322.000	MercadoLibre Inc**	2,38 %	14.01.2026	2.170.047	0,05
5.913.000	Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS*	8,25 %	15.11.2028	6.181.864	0,16
2.200.000	MGM China Holdings Ltd*	5,25 %	18.06.2025	2.162.328	0,05
11.983.000	Minera y Metalurgica del Boleo SAPI de CV*	3,25 %	17.04.2024	11.907.131	0,30
12.721.000	NBK SPC Ltd*	1,63 %	15.09.2027	11.535.950	0,29
11.700.000	Nexa Resources SA**	5,38 %	04.05.2027	11.430.875	0,29
12.646.000	NPC Ukrenergo*	6,88 %	09.11.2028	3.556.055	0,09
9.038.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	8.927.185	0,23
8.100.000	Petrobras Global Finance BV*	6,00 %	27.01.2028	8.240.154	0,21
42.992.000	Petroleos Mexicanos**	6,50 %	13.03.2027	40.104.696	1,01
5.920.000	Philippine National Bank**	3,28 %	27.09.2024	5.791.269	0,15
9.364.000	POSCO*	4,38 %	04.08.2025	9.231.060	0,23
3.931.000	POSCO**	5,75 %	17.01.2028	4.035.688	0,10
5.571.000	Powerchina Roadbridge Group British Virgin Islands Ltd**	3,08 %	29.12.2049	5.243.147	0,13
2.000.000	Prosus NV*	3,26 %	19.01.2027	1.848.732	0,05
8.561.000	QIB Sukuk Ltd*	1,95 %	27.10.2025	8.064.899	0,20
6.661.000	QIB Sukuk Ltd*	3,98 %	26.03.2024	6.627.195	0,17
41.347.000	QNB Finance Ltd*	2,63 %	12.05.2025	39.767.462	1,01
15.190.000	QNB Finance Ltd*	3,50 %	28.03.2024	15.111.787	0,38
6.700.000	Rakfunding Cayman Ltd*	4,13 %	09.04.2024	6.666.225	0,17
8.504.220	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3**	5,84 %	30.09.2027	8.626.936	0,22

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
16.989.800	Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co Ltd 3**	6,33 %	30.09.2027	17.342.947	0,44
3.385.000	REC Ltd*	3,38 %	25.07.2024	3.344.150	0,08
14.625.000	REC Ltd*	3,50 %	12.12.2024	14.349.595	0,36
5.000.000	Republic of Angola Via Avenir Issuer II Ireland DAC*	6,93 %	19.02.2027	4.662.500	0,12
20.000.000	SA Global Sukuk Ltd*	1,60 %	17.06.2026	18.586.700	0,47
5.000.000	Sands China Ltd**	4,30 %	08.01.2026	4.804.923	0,12
4.799.000	Sands China Ltd*	5,38 %	08.08.2025	4.735.647	0,12
1.000.000	Sands China Ltd**	5,65 %	08.08.2028	992.274	0,03
29.650.000	Sasol Financing USA LLC*	5,88 %	27.03.2024	29.495.233	0,75
8.000.000	Sasol Financing USA LLC*	6,50 %	27.09.2028	7.629.865	0,19
2.319.000	Saudi Arabian Oil Co*	1,63 %	24.11.2025	2.184.885	0,06
30.986.000	Saudi Arabian Oil Co*	2,88 %	16.04.2024	30.722.929	0,78
20.331.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 4*	4,22 %	27.01.2024	20.324.941	0,51
22.370.000	Saudi Electricity Global Sukuk Co 5*	1,74 %	17.09.2025	21.200.921	0,54
3.000.000	SEPLAT Energy Plc*	7,75 %	01.04.2026	2.766.000	0,07
5.000.000	Severstal OAO Via Steel Capital SA*	5,90 %	17.10.2022	500.000	0,01
4.507.000	SF Holding Investment 2021 Ltd*	2,38 %	17.11.2026	4.189.067	0,11
5.100.000	Shinhan Bank Co Ltd**	3,88 %	24.03.2026	4.930.448	0,12
6.581.000	Shinhan Financial Group Co Ltd*	1,35 %	10.01.2026	6.122.225	0,15
2.000.000	SierraCol Energy Andina LLC**	6,00 %	15.06.2028	1.684.880	0,04
4.400.000	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd**	4,38 %	10.04.2024	4.391.567	0,11
5.000.000	Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd*	3,25 %	28.04.2025	4.890.809	0,12
21.866.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd**	1,45 %	08.01.2026	20.486.227	0,52
23.800.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,15 %	13.05.2025	22.879.446	0,58
27.104.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,50 %	08.08.2024	26.651.092	0,67
7.000.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd*	2,50 %	12.11.2024	6.850.130	0,17
6.078.000	SK Hynix Inc*	6,25 %	17.01.2026	6.145.040	0,16
5.594.000	SK Hynix Inc*	6,38 %	17.01.2028	5.781.881	0,15
1.500.000	SK On Co Ltd**	5,38 %	11.05.2026	1.510.373	0,04
19.418.000	SNB Funding Ltd*	2,75 %	02.10.2024	18.968.240	0,48
17.918.000	SNB Sukuk Ltd*	2,34 %	19.01.2027	16.583.897	0,42
49.000.000	Southern Gas Corridor CJSC*	6,88 %	24.03.2026	49.847.700	1,26
7.600.000	Standard Chartered Plc*	6,19 %	06.07.2027	7.731.924	0,20
10.717.000	State Agency of Roads of Ukraine*	6,25 %	24.06.2030	2.762.307	0,07
6.725.000	Stillwater Mining Co*	4,00 %	16.11.2026	5.997.859	0,15
5.715.000	Studio City Finance Ltd**	6,00 %	15.07.2025	5.600.042	0,14
2.500.000	Studio City Finance Ltd*	6,50 %	15.01.2028	2.322.063	0,06
13.062.000	SURA Asset Management SA**	4,88 %	17.04.2024	12.982.895	0,33
3.000.000	Suzano Austria GmbH*	2,50 %	15.09.2028	2.636.542	0,07
2.000.000	Tencent Holdings Ltd**	1,81 %	26.01.2026	1.874.000	0,05

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 60,85 % (31. Dezember 2022: 68,84 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
20.847.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	2,63 %	15.08.2025	19.664.829	0,50
7.087.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	4,75 %	09.05.2027	6.794.660	0,17
3.835.000	Transnet SOC Ltd*	8,25 %	06.02.2028	3.872.832	0,10
1.500.000	Transportadora de Gas del Sur SA*	6,75 %	02.05.2025	1.436.274	0,04
14.200.000	Trust Fibra Uno**	5,25 %	15.12.2024	14.057.913	0,36
8.235.000	Trust Fibra Uno*	5,25 %	30.01.2026	8.067.427	0,20
4.521.000	TSMC Arizona Corp*	3,88 %	22.04.2027	4.423.701	0,11
2.159.000	Tullow Oil Plc*	10,25 %	15.05.2026	1.928.634	0,05
1.000.000	Turk Telekomunikasyon AS*	4,88 %	19.06.2024	983.750	0,02
1.000.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*	5,80 %	11.04.2028	950.959	0,02
7.400.000	Turkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50 %	18.10.2024	7.288.186	0,18
4.145.000	Turkiye Sinai Kalkinma Bankasi AS*	6,00 %	23.01.2025	4.137.622	0,10
9.530.000	Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS*	6,95 %	14.03.2026	9.512.084	0,24
11.723.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	5,50 %	01.10.2026	11.253.201	0,28
9.678.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	6,50 %	08.01.2026	9.614.561	0,24
9.908.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	9,00 %	12.10.2028	10.414.695	0,26
1.000.000	Vanke Real Estate Hong Kong Co Ltd*	3,98 %	09.11.2027	669.822	0,02
1.104.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95 %	11.03.2025	821.972	0,02
11.096.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	13,88 %	21.01.2024	9.806.429	0,25
2.239.000	Weibo Corp*	3,50 %	05.07.2024	2.215.233	0,06
4.638.000	Wynn Macau Ltd*	4,88 %	01.10.2024	4.582.535	0,12
2.000.000	Wynn Macau Ltd*	5,50 %	15.01.2026	1.953.759	0,05
2.500.000	Wynn Macau Ltd*	5,50 %	01.10.2027	2.363.793	0,06
7.889.000	Xingsheng BVI Co Ltd*	1,38 %	25.08.2024	7.675.839	0,19
14.418.000	XP Inc**	3,25 %	01.07.2026	13.529.367	0,34
10.201.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS**	9,25 %	16.10.2028	10.831.473	0,27
1.572.375	YPF SA**	8,50 %	23.03.2025	1.532.319	0,04
6.494.000	Yunda Holding Investment Ltd*	2,25 %	19.08.2025	5.942.750	0,15
11.868.000	Zhejiang Seaport International Co Ltd*	1,98 %	17.03.2026	11.098.123	0,28
	US-Dollar insgesamt			**2.396.291.848**	**60,59**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**2.406.487.373**	**60,85**
	Staatsanleihen 33,07 % (31. Dezember 2022: 23,53 %)				
	Euro				
3.000.000	Colombia Government International Bond*	3,88 %	22.03.2026	3.279.753	0,08
10.940.000	Egypt Government International Bond*	4,75 %	11.04.2025	11.039.251	0,28
41.167.000	Egypt Government International Bond*	4,75 %	16.04.2026	37.041.082	0,94
12.045.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,13 %	15.06.2025	13.254.266	0,34
35.305.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,25 %	22.03.2030	35.104.030	0,89
8.000.000	Kazakhstan Government International Bond*	0,60 %	30.09.2026	8.255.049	0,21

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 33,07 % (31. Dezember 2022: 23,53 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
6.053.000	Magyar Export-Import Bank Zrt*	6,00 %	16.05.2029	7.111.652	0,18
30.930.000	Romanian Government International Bond**	2,88 %	26.05.2028	32.003.722	0,81
28.500.000	Romanian Government International Bond*	5,50 %	18.09.2028	32.420.987	0,82
24.300.000	Romanian Government International Bond*	6,63 %	27.09.2029	28.766.134	0,73
18.500.000	Senegal Government International Bond*	4,75 %	13.03.2028	18.926.211	0,48
42.400.000	Serbia International Bond*	1,00 %	23.09.2028	39.651.074	1,00
88.646.000	Serbia International Bond*	3,13 %	15.05.2027	93.910.122	2,37
6.000.000	Ukraine Government International Bond**	6,75 %	20.06.2028	1.637.078	0,04
	Euro insgesamt			**362.400.411**	**9,17**
	US-Dollar				
21.984.000	Airport Authority*	1,75 %	12.01.2027	20.324.620	0,51
7.396.000	Airport Authority*	2,10 %	29.12.2049	6.848.997	0,17
54.460.000	Angolan Government International Bond*	8,25 %	09.05.2028	50.339.284	1,27
71.573.310	Argentine Republic Government International Bond*	0,75 %	09.07.2030	28.880.312	0,73
30.845.329	Argentine Republic Government International Bond*	1,00 %	09.07.2029	12.399.822	0,31
2.600.000	Bahamas Government International Bond*	5,75 %	16.01.2024	2.582.840	0,07
18.190.000	Bahamas Government International Bond*	6,00 %	21.11.2028	16.189.100	0,41
4.817.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	6,25 %	31.10.2028	5.093.404	0,13
67.662.000	Colombia Government International Bond*	3,88 %	25.04.2027	64.696.041	1,64
87.100.000	Colombia Government International Bond*	4,50 %	15.03.2029	81.832.192	2,07
26.280.000	Dominican Republic International Bond*	5,50 %	22.02.2029	25.754.400	0,65
31.050.000	Dominican Republic International Bond*	8,63 %	20.04.2027	32.555.925	0,82
27.098.882	Ecuador Government International Bond*	6,00 %	31.07.2030	12.663.548	0,32
20.779.000	Egypt Government International Bond*	5,80 %	30.09.2027	16.076.297	0,41
11.000.000	El Salvador Government International Bond*	6,38 %	18.01.2027	9.759.396	0,25
14.860.000	El Salvador Government International Bond*	7,65 %	15.06.2035	11.646.525	0,29
24.616.000	El Salvador Government International Bond*	8,63 %	28.02.2029	22.154.400	0,56
10.909.000	Fondo MIVIVIENDA SA*	4,63 %	12.04.2027	10.668.527	0,27
18.600.000	Ghana Government International Bond*	6,38 %	11.02.2027	8.352.330	0,21
25.934.000	Ghana Government International Bond*	10,75 %	14.10.2030	16.419.490	0,42
6.800.000	Guatemala Government Bond*	5,25 %	10.08.2029	6.682.700	0,17
8.741.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS*	8,51 %	14.01.2029	9.282.942	0,23
7.585.333	Honduras Government International Bond*	7,50 %	15.03.2024	7.598.608	0,19
2.365.000	Industrial Bank of Korea*	5,38 %	04.10.2028	2.443.409	0,06
11.435.000	Istanbul Metropolitan Municipality*	6,38 %	09.12.2025	11.122.860	0,28
28.609.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,38 %	23.07.2024	28.374.120	0,72
25.591.897	Ivory Coast Government International Bond*	5,75 %	31.12.2032	24.247.043	0,61
18.100.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,38 %	03.03.2028	17.823.613	0,45
9.372.000	Korea Development Bank*	4,38 %	15.02.2028	9.331.513	0,24

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 33,07 % (31. Dezember 2022: 23,53 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
3.600.000	Korea Electric Power Corp*	3,63 %	14.06.2025	3.533.925	0,09
4.465.000	Korea Electric Power Corp**	5,38 %	31.07.2026	4.515.932	0,11
4.325.000	Korea Expressway Corp*	1,13 %	17.05.2026	3.966.405	0,10
800.000	Korea Expressway Corp**	3,63 %	18.05.2025	785.420	0,02
25.371.000	Korea Housing Finance Corp*	4,63 %	24.02.2028	25.340.143	0,64
4.166.000	Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd*	5,00 %	18.07.2028	4.209.889	0,11
12.847.000	Korea Land & Housing Corp*	5,75 %	06.10.2025	12.999.108	0,33
34.802.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp*	1,75 %	15.04.2026	32.158.881	0,81
37.754.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp*	5,38 %	11.05.2028	38.168.728	0,97
29.086.000	Korea National Oil Corp*	1,75 %	18.04.2025	27.897.280	0,71
5.208.000	Magyar Export-Import Bank Zrt**	6,13 %	04.12.2027	5.306.744	0,13
14.831.000	MFB Magyar Fejlesztesi Bank Zrt*	6,50 %	29.06.2028	15.295.952	0,39
12.000.000	Mongolia Government International Bond*	5,13 %	07.04.2026	11.668.896	0,30
7.135.000	Mongolia Government International Bond*	7,88 %	05.06.2029	7.306.181	0,19
4.281.000	Mongolia Government International Bond*	8,65 %	19.01.2028	4.492.084	0,11
8.400.000	Panama Government International Bond*	9,38 %	01.04.2029	9.588.180	0,24
2.552.027	Provincia de Cordoba*	6,88 %	10.12.2025	2.322.822	0,06
5.923.077	Provincia de Mendoza Argentina*	5,75 %	19.03.2029	5.079.038	0,13
11.651.000	Qatar Government International Bond*	3,38 %	14.03.2024	11.600.621	0,29
2.000.000	Republic of Azerbaijan International Bond*	5,13 %	01.09.2029	1.968.661	0,05
11.400.000	Republic of South Africa Government International Bond*	4,30 %	12.10.2028	10.688.184	0,27
36.381.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,75 %	18.04.2023	18.713.477	0,47
18.000.000	Sri Lanka Government International Bond*	5,88 %	25.07.2024	9.531.000	0,24
21.600.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,35 %	28.06.2024	11.000.978	0,28
27.037.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	14.03.2024	13.767.931	0,35
11.086.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS*	9,00 %	28.01.2027	11.558.729	0,29
13.000.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2025	3.901.950	0,10
28.000.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2026	7.864.080	0,20
14.819.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2027	4.099.232	0,10
4.975.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2028	1.392.592	0,04
2.059.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2029	570.975	0,01
19.500.000	Ukraine Government International Bond*	8,99 %	01.02.2026	5.854.504	0,15
44.000.000	United States Treasury Note/Bond*	4,88 %	31.10.2028	45.938.750	1,16
	US-Dollar insgesamt			**945.231.530**	**23,90**
	Staatsanleihen insgesamt			**1.307.631.941**	**33,07**

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Investmentfonds 1,26 % (31. Dezember 2022: 1,37 %)		
	US-Dollar		
425.000	Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	49.810.000	1,26
	Investmentfonds insgesamt [µ]	**49.810.000**	**1,26**
	Anlagen insgesamt	**3.817.824.018**	**96,54**

Devisenterminkontrakte 1,63 % (31. Dezember 2022: 0,91 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettovermögens
2.836.841 €	3.096.767 US$	03.01.2024	HSBC Bank Plc	1	36.950	0,00
362.543.621 US$	327.678.853 €	02.02.2024	Citibank NA	1	106.705	0,00
Abgesicherte Klassen AUD						
16.296 AUD	10.969 US$	14.03.2024	UBS AG	1	175	0,00
1.580.561 AUD	1.043.454 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	4	37.390	0,00
Abgesicherte Klassen CAD						
9.019 CAD	6.701 US$	14.03.2024	Royal Bank of Canada	2	146	0,00
412.652 CAD	304.437 US$	14.03.2024	UBS AG	1	8.820	0,00
Abgesicherte Klassen CHF						
52.107.122 CHF	60.188.514 US$	14.03.2024	UBS AG	2	2.179.000	0,05
1.240.926 CHF	1.442.941 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	12	42.334	0,00
Abgesicherte Klassen EUR						
1.513.836.232 €	1.641.250.975 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	2	35.826.994	0,91
36.851.057 €	40.403.156 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	9	421.668	0,01
319 US$	286 €	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	2	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
1.659.477 £	2.110.860 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	5.404	0,00
163.847.220 £	206.632.153 US$	14.03.2024	UBS AG	2	2.315.605	0,06
2.790.507 £	3.517.275 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	8	41.346	0,00
118.401 US$	92.738 £	14.03.2024	Westpac Banking Corp	3	137	0,00
Abgesicherte Klassen JPY						
934.431.663 ¥	6.681.324 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	2	21.128	0,00
67.882.901.314 ¥	468.439.553 US$	14.03.2024	Royal Bank of Canada	1	18.468.033	0,47
15.983.234.491 ¥	110.337.182 US$	14.03.2024	UBS AG	1	4.306.683	0,11
Abgesicherte Klassen SEK						
109.907 SEK	10.762 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	175	0,00
10.977.514 SEK	1.051.317 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	5	41.035	0,00
13.562 US$	134.116 SEK	14.03.2024	Westpac Banking Corp	3	217	0,00
Abgesicherte Klassen SGD						
59.708.958 SGD	44.733.394 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	4	681.222	0,02
1.455.817 SGD	1.096.418 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	14	10.877	0,00
109 US$	143 SGD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞]					**64.552.046**	**1,63**

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**3.882.376.064**	**98,17**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,23 %) (31. Dezember 2022: (0,47 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
327.678.853 €	362.117.900 US$	03.01.2024	Citibank NA	1	(147.411)	(0,00)
361.721.300 US$	330.515.694 €	03.01.2024	HSBC Bank Plc	1	(3.382.906)	(0,09)
Abgesicherte Klassen AUD						
69 US$	104 AUD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	(2)	(0,00)
Abgesicherte Klassen CHF						
20 CHF	24 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
1.278.815 US$	1.108.907 CHF	14.03.2024	Westpac Banking Corp	12	(48.447)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
557.934 €	621.511 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	(3.413)	(0,00)
222.684.679 US$	205.478.903 €	14.03.2024	UBS AG	1	(4.951.663)	(0,12)
33.545.582 US$	30.519.106 €	14.03.2024	Westpac Banking Corp	18	(264.497)	(0,01)
Abgesicherte Klassen GBP						
406.649 £	519.069 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	5	(485)	(0,00)
5.574.630 US$	4.420.535 £	14.03.2024	Westpac Banking Corp	15	(62.701)	(0,00)
Abgesicherte Klassen JPY						
910.000 ¥	6.530 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
15.742.601 US$	2.232.166.170 ¥	14.03.2024	Westpac Banking Corp	4	(268.185)	(0,01)
Abgesicherte Klassen SEK						
1.008 SEK	102 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
33.296 US$	342.704 SEK	14.03.2024	Westpac Banking Corp	6	(805)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SGD						
36.337 SGD	27.656 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	(19)	(0,00)
67.547 US$	90.299 SGD	14.03.2024	Westpac Banking Corp	13	(1.137)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(9.131.675)**	**(0,23)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(9.131.675)**	**(0,23)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**3.873.244.389**	**97,94**
Sonstiges Nettovermögen	**81.525.178**	**2,06**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**3.954.769.567**	**100,00**

Short Duration Emerging Market Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

	Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	3.059.546.367	77,06
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	708.467.651	17,84
µ	Investmentfonds	49.810.000	1,25
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	55.420.371	1,40
Anlagen insgesamt		**3.873.244.389**	**97,55**

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %)				
	US-Dollar				
2.625.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	3,88 %	15.01.2028	2.481.802	0,33
4.010.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	4,38 %	15.01.2028	3.833.520	0,51
725.000	Acadia Healthcare Co Inc**	5,50 %	01.07.2028	714.867	0,10
3.400.000	Adient Global Holdings Ltd**	4,88 %	15.08.2026	3.326.858	0,45
690.000	Adient Global Holdings Ltd**	7,00 %	15.04.2028	713.641	0,10
5.700.000	Advanced Drainage Systems Inc**	5,00 %	30.09.2027	5.506.115	0,74
600.000	AerCap Global Aviation Trust*	6,50 %	15.06.2045	601.614	0,08
900.000	AerCap Holdings NV*	5,88 %	10.10.2079	889.666	0,12
1.515.000	Ahlstrom Holding 3 Oy*	4,88 %	04.02.2028	1.330.176	0,18
1.725.000	Air Canada**	3,88 %	15.08.2026	1.649.134	0,22
790.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	3,25 %	15.03.2026	745.863	0,10
530.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	4,63 %	15.01.2027	515.599	0,07
1.235.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	5,88 %	15.02.2028	1.236.601	0,17
4.390.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	6,50 %	15.02.2028	4.445.195	0,60
685.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	7,50 %	15.03.2026	698.154	0,09
2.890.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	4,25 %	15.10.2027	2.779.963	0,37
4.400.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.10.2027	4.389.000	0,59
1.735.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.04.2028	1.776.041	0,24
1.185.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**	6,63 %	15.07.2026	1.179.891	0,16
360.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp**	9,75 %	15.07.2027	353.166	0,05
790.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl**	4,63 %	01.06.2028	719.087	0,10
410.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 144A**	4,63 %	01.06.2028	375.146	0,05
5.580.000	Ally Financial Inc*	5,75 %	20.11.2025	5.549.495	0,75
3.940.000	Altice Financing SA**	5,00 %	15.01.2028	3.574.610	0,48
1.330.000	Altice France SA*	5,50 %	15.01.2028	1.096.406	0,15
3.825.000	Altice France SA**	8,13 %	01.02.2027	3.529.119	0,47
6.045.000	American Airlines Inc**	7,25 %	15.02.2028	6.119.626	0,82
2.458.334	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50 %	20.04.2026	2.442.407	0,33
5.315.000	Amsted Industries Inc**	5,63 %	01.07.2027	5.301.250	0,71
5.745.000	APX Group Inc**	6,75 %	15.02.2027	5.738.738	0,77
1.895.000	Aramark Services Inc**	5,00 %	01.02.2028	1.839.495	0,25
750.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	3,25 %	01.09.2028	656.984	0,09
3.155.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	6,00 %	15.06.2027	3.145.669	0,42
1.970.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	5,25 %	15.08.2027	1.532.738	0,21
4.620.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	7,00 %	01.11.2026	4.656.239	0,63
2.130.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	8,25 %	31.12.2028	2.144.870	0,29
5.315.000	ASGN Inc**	4,63 %	15.05.2028	5.052.583	0,68
4.525.000	AssuredPartners Inc**	7,00 %	15.08.2025	4.537.480	0,61
1.255.000	ATI Inc*	5,88 %	01.12.2027	1.238.263	0,17

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
395.000	ATS Corp**	4,13 %	15.12.2028	363.570	0,05
1.190.000	Avantor Funding Inc**	4,63 %	15.07.2028	1.150.981	0,15
5.405.000	Avient Corp**	5,75 %	15.05.2025	5.410.616	0,73
1.165.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	4,75 %	01.04.2028	1.073.690	0,14
775.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,38 %	01.03.2029	717.769	0,10
1.455.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc**	5,75 %	15.07.2027	1.412.259	0,19
1.130.000	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance Inc 144A**	5,75 %	15.07.2027	1.084.125	0,15
1.760.000	Avolon Holdings Funding Ltd**	6,38 %	04.05.2028	1.796.152	0,24
400.000	Axalta Coating Systems LLC**	3,38 %	15.02.2029	359.368	0,05
3.740.000	Axalta Coating Systems LLC/Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV**	4,75 %	15.06.2027	3.638.039	0,49
1.310.000	Bank of America Corp**	6,13 %	29.12.2049	1.316.419	0,18
3.675.000	Bath & Body Works Inc*	5,25 %	01.02.2028	3.638.253	0,49
1.155.000	Bausch & Lomb Escrow Corp**	8,38 %	01.10.2028	1.219.899	0,16
585.000	Bausch Health Cos Inc**	4,88 %	01.06.2028	353.026	0,05
4.140.000	Bausch Health Cos Inc**	5,50 %	01.11.2025	3.790.977	0,51
655.000	Bausch Health Cos Inc**	6,13 %	01.02.2027	442.819	0,06
3.860.000	BCPE Empire Holdings Inc**	7,63 %	01.05.2027	3.726.062	0,50
490.000	Beacon Roofing Supply Inc**	4,50 %	15.11.2026	477.842	0,06
4.775.000	Benteler International AG**	10,50 %	15.05.2028	5.033.924	0,68
2.965.000	Berry Global Inc**	5,63 %	15.07.2027	2.945.863	0,40
1.320.000	Blackstone Mortgage Trust Inc**	3,75 %	15.01.2027	1.175.232	0,16
2.640.000	Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**	6,63 %	15.07.2026	2.626.523	0,35
4.345.000	Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp**	7,63 %	15.12.2025	4.406.060	0,59
1.835.000	Bombardier Inc**	6,00 %	15.02.2028	1.790.007	0,24
1.390.000	Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**	10,00 %	15.11.2028	1.452.550	0,19
5.265.000	Buckeye Partners LP**	4,13 %	01.12.2027	4.995.508	0,67
735.000	Buckeye Partners LP**	4,50 %	01.03.2028	693.137	0,09
860.000	Cablevision Lightpath LLC**	3,88 %	15.09.2027	756.052	0,10
1.995.000	Calderys Financing LLC**	11,25 %	01.06.2028	2.092.038	0,28
7.110.000	Camelot Return Merger Sub Inc**	8,75 %	01.08.2028	7.226.065	0,97
1.490.000	Catalent Pharma Solutions Inc**	5,00 %	15.07.2027	1.441.124	0,19
3.900.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,00 %	01.02.2028	3.734.494	0,50
6.715.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,13 %	01.05.2027	6.492.026	0,87
1.990.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,50 %	01.05.2026	1.977.991	0,27
5.295.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	6,50 %	01.10.2028	5.262.791	0,71
1.020.000	Chesapeake Energy Corp**	5,50 %	01.02.2026	1.012.084	0,14
1.135.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,63 %	15.03.2027	1.056.053	0,14

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.376.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00 %	15.03.2026	1.372.653	0,18
735.000	Civitas Resources Inc**	5,00 %	15.10.2026	713.507	0,10
6.580.000	Civitas Resources Inc**	8,38 %	01.07.2028	6.877.383	0,92
2.025.000	CommScope Inc**	6,00 %	01.03.2026	1.806.705	0,24
1.750.000	CommScope Inc**	8,25 %	01.03.2027	925.593	0,12
440.000	CommScope Technologies LLC**	5,00 %	15.03.2027	183.561	0,02
1.565.000	Consensus Cloud Solutions Inc**	6,00 %	15.10.2026	1.489.583	0,20
1.885.000	Coty Inc**	5,00 %	15.04.2026	1.856.399	0,25
4.885.000	CSC Holdings LLC**	5,25 %	01.06.2024	4.785.547	0,64
4.835.000	CSC Holdings LLC**	5,50 %	15.04.2027	4.472.216	0,60
1.865.000	CSC Holdings LLC**	11,25 %	15.05.2028	1.922.936	0,26
4.560.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC**	6,75 %	15.05.2028	4.541.828	0,61
3.390.000	Dana Inc*	5,38 %	15.11.2027	3.369.660	0,45
2.090.000	Dana Inc*	5,63 %	15.06.2028	2.062.473	0,28
555.000	Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC**	8,00 %	01.02.2028	550.097	0,07
3.530.000	DISH DBS Corp**	5,25 %	01.12.2026	3.030.946	0,41
1.160.000	DISH DBS Corp**	7,75 %	01.07.2026	809.146	0,11
2.135.000	DISH Network Corp**	3,38 %	15.08.2026	1.142.225	0,15
1.740.000	DISH Network Corp**	11,75 %	15.11.2027	1.817.729	0,24
1.735.000	Edgewell Personal Care Co**	5,50 %	01.06.2028	1.704.377	0,23
1.120.000	Encompass Health Corp*	4,50 %	01.02.2028	1.072.623	0,14
720.000	Encompass Health Corp*	5,75 %	15.09.2025	717.788	0,10
2.010.000	Energizer Holdings Inc**	4,75 %	15.06.2028	1.860.431	0,25
4.820.000	Energizer Holdings Inc**	6,50 %	31.12.2027	4.824.969	0,65
3.480.000	Energy Transfer LP**	5,63 %	01.05.2027	3.470.431	0,47
385.000	Energy Transfer LP*	5,75 %	01.04.2025	385.395	0,05
5.830.000	EnerSys**	4,38 %	15.12.2027	5.542.144	0,74
2.125.000	Enviri Corp**	5,75 %	31.07.2027	1.982.997	0,27
755.000	EQM Midstream Partners LP**	4,50 %	15.01.2029	713.955	0,10
1.495.000	EQM Midstream Partners LP**	6,00 %	01.07.2025	1.495.248	0,20
800.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2027	824.818	0,11
4.980.000	EquipmentShare.com Inc**	9,00 %	15.05.2028	5.129.898	0,69
2.142.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50 %	01.04.2025	2.044.336	0,27
660.000	Ford Motor Credit Co LLC*	2,70 %	10.08.2026	611.578	0,08
1.115.000	Ford Motor Credit Co LLC*	2,90 %	16.02.2028	1.001.967	0,13
2.440.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,38 %	13.11.2025	2.336.015	0,31
770.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,39 %	08.01.2026	749.226	0,10
995.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,95 %	28.05.2027	971.472	0,13

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.125.000	Ford Motor Credit Co LLC*	6,95 %	10.06.2026	1.154.758	0,15
2.105.000	Ford Motor Credit Co LLC*	7,35 %	04.11.2027	2.221.266	0,30
1.890.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,00 %	01.05.2028	1.748.433	0,23
4.680.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88 %	15.10.2027	4.525.238	0,61
1.100.000	Gates Global LLC/Gates Corp**	6,25 %	15.01.2026	1.095.699	0,15
5.135.000	Gen Digital Inc**	6,75 %	30.09.2027	5.227.194	0,70
3.760.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00 %	15.01.2027	3.825.067	0,51
1.320.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,25 %	15.01.2029	1.359.389	0,18
2.869.170	Global Aircraft Leasing Co Ltd**	6,50 %	15.09.2024	2.700.362	0,36
2.385.000	Go Daddy Operating Co LLC/GD Finance Co Inc**	5,25 %	01.12.2027	2.339.263	0,31
1.425.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	4,88 %	15.03.2027	1.380.658	0,19
2.690.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	9,50 %	31.05.2025	2.731.278	0,37
3.635.000	GTCR AP Finance Inc**	8,00 %	15.05.2027	3.676.832	0,49
5.145.000	Hertz Corp**	4,63 %	01.12.2026	4.617.455	0,62
3.360.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	6,25 %	01.11.2028	3.350.785	0,45
3.245.000	Howard Midstream Energy Partners LLC**	6,75 %	15.01.2027	3.212.137	0,43
2.685.000	Howard Midstream Energy Partners LLC**	8,88 %	15.07.2028	2.820.993	0,38
1.505.000	Hudbay Minerals Inc**	4,50 %	01.04.2026	1.459.318	0,20
1.155.000	IHO Verwaltungs GmbH**	4,75 %	15.09.2026	1.107.605	0,15
730.000	IHO Verwaltungs GmbH*	6,00 %	15.05.2027	712.041	0,10
3.735.000	Iliad Holding SASU**	6,50 %	15.10.2026	3.730.363	0,50
1.810.000	Iliad Holding SASU**	7,00 %	15.10.2028	1.802.423	0,24
510.000	Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV Inc**	9,00 %	01.07.2028	488.274	0,07
2.345.000	INEOS Finance Plc*	6,75 %	15.05.2028	2.305.667	0,31
900.000	INEOS Quattro Finance 2 Plc**	9,63 %	15.03.2029	959.140	0,13
1.845.000	IQVIA Inc**	5,00 %	15.05.2027	1.811.919	0,24
3.055.000	Iron Mountain Inc**	4,88 %	15.09.2027	2.983.011	0,40
1.785.000	Iron Mountain Inc**	5,25 %	15.03.2028	1.736.577	0,23
2.373.000	JELD-WEN Inc**	4,63 %	15.12.2025	2.298.322	0,31
3.990.000	JELD-WEN Inc**	4,88 %	15.12.2027	3.774.740	0,51
2.905.000	JPMorgan Chase & Co**	4,60 %	29.12.2049	2.808.612	0,38
3.200.000	KB Home*	6,88 %	15.06.2027	3.330.204	0,45
1.905.000	Kinetik Holdings LP**	6,63 %	15.12.2028	1.942.026	0,26
760.000	Kohl's Corp*	4,25 %	17.07.2025	742.355	0,10
2.775.000	Legacy LifePoint Health LLC**	4,38 %	15.02.2027	2.564.985	0,34
1.145.000	Level 3 Financing Inc**	3,40 %	01.03.2027	1.094.519	0,15
1.570.000	Level 3 Financing Inc**	4,25 %	01.07.2028	871.873	0,12
1.490.000	Level 3 Financing Inc**	4,63 %	15.09.2027	900.513	0,12

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.905.000	Level 3 Financing Inc**	10,50 %	15.05.2030	1.819.987	0,24
1.105.000	Lindblad Expeditions Holdings Inc**	9,00 %	15.05.2028	1.147.504	0,15
2.805.000	Lindblad Expeditions LLC**	6,75 %	15.02.2027	2.793.359	0,37
720.000	Live Nation Entertainment Inc**	3,75 %	15.01.2028	673.267	0,09
3.200.000	Live Nation Entertainment Inc**	4,75 %	15.10.2027	3.071.040	0,41
1.955.000	Live Nation Entertainment Inc**	5,63 %	15.03.2026	1.938.901	0,26
790.000	LPL Holdings Inc**	4,00 %	15.03.2029	731.980	0,10
945.000	LPL Holdings Inc**	4,63 %	15.11.2027	913.572	0,12
1.230.000	Lumen Technologies Inc**	4,00 %	15.02.2027	794.961	0,11
2.425.000	Madison IAQ LLC**	4,13 %	30.06.2028	2.207.090	0,30
5.155.000	Manitowoc Co Inc**	9,00 %	01.04.2026	5.193.299	0,70
4.330.000	Masonite International Corp**	5,38 %	01.02.2028	4.162.689	0,56
6.165.000	Mattamy Group Corp**	5,25 %	15.12.2027	6.000.856	0,81
5.415.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,88 %	15.08.2026	5.515.616	0,74
1.105.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	9,25 %	15.04.2027	1.085.817	0,15
2.805.000	McGraw-Hill Education Inc**	5,75 %	01.08.2028	2.707.582	0,36
2.325.000	Meritage Homes Corp*	5,13 %	06.06.2027	2.293.571	0,31
1.165.000	Midcontinent Communications/Midcontinent Finance Corp**	5,38 %	15.08.2027	1.136.568	0,15
3.325.000	Molina Healthcare Inc**	4,38 %	15.06.2028	3.147.957	0,42
920.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,00 %	15.10.2027	752.323	0,10
3.050.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,25 %	01.08.2026	2.730.003	0,37
1.090.000	Nabors Industries Inc**	7,38 %	15.05.2027	1.069.010	0,14
1.990.000	NCL Corp Ltd**	8,38 %	01.02.2028	2.108.445	0,28
4.625.000	New Fortress Energy Inc**	6,50 %	30.09.2026	4.446.049	0,60
2.830.000	New Fortress Energy Inc**	6,75 %	15.09.2025	2.809.684	0,38
735.000	Newell Brands Inc**	5,20 %	01.04.2026	725.372	0,10
745.000	NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC**	7,13 %	01.04.2026	716.505	0,10
1.435.000	Northern Oil & Gas Inc**	8,13 %	01.03.2028	1.454.430	0,20
2.905.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	4,75 %	30.04.2027	2.776.584	0,37
1.120.000	NOVA Chemicals Corp**	5,00 %	01.05.2025	1.093.603	0,15
1.600.000	NOVA Chemicals Corp**	5,25 %	01.06.2027	1.501.982	0,20
1.155.000	Novelis Corp**	3,25 %	15.11.2026	1.088.084	0,15
1.300.000	NuStar Logistics LP*	5,75 %	01.10.2025	1.292.960	0,17
1.190.000	Olympus Water US Holding Corp**	4,25 %	01.10.2028	1.072.142	0,14
4.670.000	Olympus Water US Holding Corp**	7,13 %	01.10.2027	4.678.850	0,63
1.655.000	OneMain Finance Corp*	3,50 %	15.01.2027	1.532.793	0,21
900.000	OneMain Finance Corp*	3,88 %	15.09.2028	797.008	0,11
925.000	OneMain Finance Corp*	6,63 %	15.01.2028	934.531	0,13

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
745.000	OneMain Finance Corp**	6,88 %	15.03.2025	754.748	0,10
3.885.000	OneMain Finance Corp**	7,13 %	15.03.2026	3.960.618	0,53
2.925.000	Open Text Corp**	3,88 %	15.02.2028	2.719.774	0,36
2.885.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC**	4,00 %	15.10.2027	2.699.278	0,36
2.825.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	5,88 %	01.10.2028	2.780.917	0,37
6.390.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	7,50 %	01.06.2025	6.430.190	0,86
2.305.000	Performance Food Group Inc**	5,50 %	15.10.2027	2.273.660	0,31
4.240.000	Performance Food Group Inc**	6,88 %	01.05.2025	4.255.137	0,57
865.000	Permian Resources Operating LLC**	5,38 %	15.01.2026	854.247	0,11
2.300.000	Permian Resources Operating LLC**	7,75 %	15.02.2026	2.341.929	0,31
4.735.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**	4,75 %	15.02.2028	4.467.587	0,60
590.000	Presidio Holdings Inc**	4,88 %	01.02.2027	578.869	0,08
2.275.000	Presidio Holdings Inc**	8,25 %	01.02.2028	2.300.712	0,31
1.435.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	3,38 %	31.08.2027	1.331.422	0,18
2.795.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75 %	15.04.2026	2.811.904	0,38
4.650.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25 %	15.01.2028	4.626.511	0,62
3.690.000	Qwest Corp**	7,25 %	15.09.2025	3.619.798	0,49
1.725.000	Regal Rexnord Corp**	6,05 %	15.02.2026	1.744.454	0,23
1.790.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,75 %	15.10.2027	1.730.259	0,23
1.190.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	7,25 %	15.07.2028	1.237.971	0,17
2.875.000	Ritchie Bros Holdings Inc**	6,75 %	15.03.2028	2.963.614	0,40
6.660.000	RLJ Lodging Trust LP**	3,75 %	01.07.2026	6.315.373	0,85
1.330.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	4,25 %	01.07.2026	1.285.444	0,17
2.185.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	01.04.2028	2.158.526	0,29
2.805.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	11,63 %	15.08.2027	3.054.292	0,41
1.305.000	SCIH Salt Holdings Inc**	4,88 %	01.05.2028	1.222.206	0,16
815.000	SCIL IV LLC/SCIL USA Holdings LLC**	5,38 %	01.11.2026	783.310	0,10
3.700.000	Select Medical Corp**	6,25 %	15.08.2026	3.720.883	0,50
5.930.000	Sirius XM Radio Inc**	4,00 %	15.07.2028	5.488.113	0,74
2.115.000	Sirius XM Radio Inc**	5,00 %	01.08.2027	2.044.398	0,27
2.818.000	Six Flags Entertainment Corp**	5,50 %	15.04.2027	2.757.090	0,37
3.070.000	SNF Group SACA**	3,13 %	15.03.2027	2.796.282	0,38
5.340.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63 %	01.04.2026	5.418.514	0,73
1.960.000	SRS Distribution Inc**	4,63 %	01.07.2028	1.861.629	0,25
2.890.000	SRS Distribution Inc**	6,00 %	01.12.2029	2.698.007	0,36
5.935.000	Standard Industries Inc**	5,00 %	15.02.2027	5.790.790	0,78
1.610.000	Starwood Property Trust Inc**	3,63 %	15.07.2026	1.526.538	0,20
2.605.000	Starwood Property Trust Inc**	4,38 %	15.01.2027	2.457.778	0,33

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
930.000	Summer BC Bidco B LLC**	5,50 %	31.10.2026	871.973	0,12
735.000	Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp**	5,25 %	15.01.2029	711.800	0,10
3.110.000	Sunnova Energy Corp**	5,88 %	01.09.2026	2.650.155	0,36
3.270.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50 %	15.01.2028	3.093.595	0,42
3.090.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	01.03.2027	3.024.770	0,41
1.840.000	Taylor Morrison Communities Inc**	5,88 %	15.06.2027	1.851.307	0,25
2.325.000	Team Health Holdings Inc†	13,50 %	30.06.2028	2.278.500	0,31
720.000	Telecom Italia SpA*	5,30 %	30.05.2024	717.238	0,10
1.705.000	Tempo Acquisition LLC/Tempo Acquisition Finance Corp**	5,75 %	01.06.2025	1.709.723	0,23
1.530.000	Tenet Healthcare Corp**	4,63 %	15.06.2028	1.461.056	0,20
1.660.000	Tenet Healthcare Corp**	5,13 %	01.11.2027	1.623.938	0,22
3.115.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	01.10.2028	3.108.926	0,42
5.875.000	Tenet Healthcare Corp**	6,25 %	01.02.2027	5.907.935	0,79
5.680.000	TK Elevator US Newco Inc**	5,25 %	15.07.2027	5.583.650	0,75
1.205.000	TMS International Corp**	6,25 %	15.04.2029	995.758	0,13
1.530.000	TransDigm Inc*	4,63 %	15.01.2029	1.437.435	0,19
3.835.000	TransDigm Inc*	5,50 %	15.11.2027	3.760.457	0,50
2.095.000	TransDigm Inc**	6,25 %	15.03.2026	2.093.507	0,28
2.330.000	TransDigm Inc**	6,75 %	15.08.2028	2.386.694	0,32
6.680.000	TransDigm Inc*	7,50 %	15.03.2027	6.718.016	0,90
344.000	TreeHouse Foods Inc*	4,00 %	01.09.2028	304.939	0,04
1.725.000	TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc*	5,88 %	15.06.2024	1.726.975	0,23
2.410.000	Tri Pointe Homes Inc*	5,25 %	01.06.2027	2.370.560	0,32
6.855.000	Trivium Packaging Finance BV*	5,50 %	15.08.2026	6.732.665	0,90
790.000	TTM Technologies Inc**	4,00 %	01.03.2029	718.576	0,10
1.750.000	Uber Technologies Inc**	6,25 %	15.01.2028	1.755.937	0,24
3.035.000	United Airlines Inc**	4,38 %	15.04.2026	2.959.703	0,40
2.035.000	United Rentals North America Inc*	4,88 %	15.01.2028	1.988.215	0,27
715.000	United Rentals North America Inc*	5,50 %	15.05.2027	717.076	0,10
2.805.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	10,50 %	15.02.2028	2.846.121	0,38
910.000	US Acute Care Solutions LLC**	6,38 %	01.03.2026	761.397	0,10
750.000	US Foods Inc**	4,75 %	15.02.2029	712.878	0,10
1.265.000	US Foods Inc**	6,88 %	15.09.2028	1.303.722	0,17
2.810.000	Venture Global LNG Inc**	9,50 %	01.02.2029	2.975.206	0,40
715.000	Viasat Inc**	5,63 %	15.09.2025	697.850	0,09
1.250.000	Viking Cruises Ltd**	5,88 %	15.09.2027	1.207.344	0,16
2.050.000	Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC*	5,00 %	15.07.2028	1.927.409	0,26
2.575.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	7,88 %	01.05.2027	2.217.735	0,30

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 89,20 % (31. Dezember 2022: 85,85 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.690.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	9,50 %	01.06.2028	1.432.338	0,19
6.300.000	VOC Escrow Ltd**	5,00 %	15.02.2028	6.038.198	0,81
1.895.000	White Cap Buyer LLC**	6,88 %	15.10.2028	1.836.751	0,25
2.615.000	White Cap Parent LLC**	8,25 %	15.03.2026	2.606.274	0,35
3.830.000	William Carter Co**	5,63 %	15.03.2027	3.784.518	0,51
2.635.000	WR Grace Holdings LLC**	4,88 %	15.06.2027	2.538.429	0,34
1.880.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc**	4,38 %	15.08.2028	1.759.258	0,24
7.950.000	XHR LP**	6,38 %	15.08.2025	7.936.922	1,07
1.795.000	XPO Inc**	6,25 %	01.06.2028	1.819.924	0,24
740.000	Zayo Group Holdings Inc**	4,00 %	01.03.2027	594.068	0,08
1.930.000	ZF North America Capital Inc**	4,75 %	29.04.2025	1.909.339	0,26
1.860.000	ZF North America Capital Inc**	6,88 %	14.04.2028	1.928.623	0,26
	Unternehmensanleihen insgesamt			**664.013.737**	**89,20**
	Mittelfristige Schuldverschreibungen 1,80 % (31. Dezember 2022: 4,24 %)				
	US-Dollar				
397.000	AAdvantage Loyalty IP Ltd	10,43 %	20.04.2028	408.446	0,06
688.714	AppLovin Corp	8,56 %	25.10.2028	690.050	0,09
643.874	CQP Holdco LP	8,35 %	31.12.2030	646.144	0,09
2.311.824	Engineered Machinery Holdings Inc	11,61 %	21.05.2029	2.184.674	0,29
242.157	First Brands Group LLC	10,88 %	30.03.2027	240.644	0,03
518.778	Gates Global LLC	7,96 %	31.03.2027	520.261	0,07
875.526	Gen Digital Inc	7,46 %	12.09.2029	877.850	0,12
207.331	GYP Holdings III Corp	8,36 %	12.05.2030	208.433	0,03
623.762	Ingram Micro Inc	8,61 %	30.06.2028	626.491	0,08
478.776	McGraw-Hill Education Inc	10,22 %	28.07.2028	478.926	0,06
1.512.421	Medline Borrower LP	8,47 %	23.10.2028	1.521.753	0,21
916.305	MKS Instruments Inc	7,84 %	17.08.2029	919.988	0,12
1.558.217	Nautilus Power LLC	10,86 %	16.11.2026	1.274.676	0,17
690.618	Peraton Corp	9,21 %	01.02.2028	693.208	0,09
1.077.279	Petco Health and Wellness Co Inc	8,86 %	03.03.2028	1.021.395	0,14
935.000	Star Parent Inc	9,35 %	27.09.2030	926.300	0,13
179.765	TransDigm Inc	8,60 %	24.08.2028	180.808	0,02
	Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †			**13.420.047**	**1,80**

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Investmentfonds 0.03 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)		
	Britisches Pfund		
270.876	NB Global Monthly Income Fund Ltd	241.028	0,03
	Investmentfonds insgesamt [µ]	**241.028**	**0,03**
	Anlagen insgesamt	**677.674.812**	**91,03**

Devisenterminkontrakte 2,05 % (31. Dezember 2022: 4,13 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettovermögens
Abgesicherte Klassen AUD						
20.022 AUD	13.250 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	419	0,00
1.267.061 AUD	815.990 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	9	49.040	0,01
Abgesicherte Klassen CHF						
5.921 CHF	6.826 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	220	0,00
24.798 CHF	28.072 US$	18.01.2024	UBS AG	5	1.440	0,00
1.527.925 CHF	1.708.033 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	110.322	0,02
Abgesicherte Klassen CNY						
59.248 CNY	8.204 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	126	0,00
2.536.061 CNY	349.124 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	6	7.422	0,00
Abgesicherte Klassen EUR						
709.472 €	755.896 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	28.310	0,00
81.921.988 €	87.350.544 US$	18.01.2024	UBS AG	6	3.200.905	0,43
84.128.760 €	89.660.938 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	39	3.329.737	0,45
44.029 US$	39.623 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	233	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
59.631.949 £	73.251.235 US$	18.01.2024	UBS AG	4	2.774.238	0,37
4.650.083 £	5.739.514 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	34	188.933	0,03
9 US$	7 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
Abgesicherte Klassen HKD						
21.546 HKD	2.757 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	3	0,00
27.407 HKD	3.508 US$	18.01.2024	UBS AG	2	3	0,00
1.493.658 HKD	191.237 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	114	0,00
Abgesicherte Klassen JPY						
217.947.720 ¥	1.520.952 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	28.725	0,00
631.415.139 ¥	4.323.421 US$	18.01.2024	UBS AG	5	166.136	0,02
18.634.006.546 ¥	127.207.191 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	5.286.400	0,71
Abgesicherte Klassen SGD						
3.400.398 SGD	2.502.621 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	77.081	0,01
27.183 SGD	20.425 US$	18.01.2024	UBS AG	1	197	0,00

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 2,05 % (31. Dezember 2022: 4,13 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen SGD (Fortsetzung)						
516.163 SGD	386.669 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	34	4.916	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞]					**15.254.920**	**2,05**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**692.929.732**	**93,08**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,42 %) (31. Dezember 2022: (0,95 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
2.706.048 US$	2.216.332 £	18.01.2024	UBS AG	1	(119.580)	(0,02)
Abgesicherte Klassen AUD						
9.898 US$	15.583 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(740)	(0,00)
84.937 US$	130.598 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(4.223)	(0,00)
Abgesicherte Klassen CHF						
5.015 US$	4.462 CHF	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(295)	(0,00)
4.873 US$	4.306 CHF	18.01.2024	UBS AG	1	(252)	(0,00)
973.224 US$	869.131 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(61.112)	(0,01)
Abgesicherte Klassen CNY						
12.851 CNY	1.810 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(3)	(0,00)
78.835 US$	572.752 CNY	18.01.2024	Westpac Banking Corp	6	(1.688)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
22.204 €	24.678 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(136)	(0,00)
721.750 US$	682.768 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(32.939)	(0,00)
27.314.082 US$	25.628.592 €	18.01.2024	UBS AG	1	(1.014.163)	(0,14)
34.056.200 US$	31.921.213 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	71	(1.227.515)	(0,16)
Abgesicherte Klassen GBP						
364.138 £	465.774 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(1.531)	(0,00)
738 £	942 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
461.832 US$	380.253 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(22.957)	(0,00)
5.349.117 US$	4.355.860 £	18.01.2024	UBS AG	2	(204.221)	(0,03)
1.728.764 US$	1.415.716 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	18	(76.149)	(0,01)
Abgesicherte Klassen HKD						
13.704 HKD	1.757 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(1)	(0,00)
8.471 HKD	1.086 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
2.489 US$	19.454 HKD	18.01.2024	UBS AG	2	(3)	(0,00)

Short Duration High Yield SDG Engagement - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,42 %) (31. Dezember 2022: (0,95 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen JPY						
766.864 US$	113.274.004 ¥	18.01.2024	UBS AG	1	(38.550)	(0,01)
6.185.450 US$	911.327.371 ¥	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	(294.372)	(0,04)
Abgesicherte Klassen SGD						
267.211 SGD	203.130 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(411)	(0,00)
359.457 US$	488.407 SGD	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(11.071)	(0,00)
82.978 US$	112.239 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	16	(2.172)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(3.114.085)**	**(0,42)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(3.114.085)**	**(0,42)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**689.815.647**	**92,66**
Sonstiges Nettovermögen	**54.618.800**	**7,34**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**744.434.447**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	82.006.991	10,79
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	579.728.246	76,30
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	15.698.547	2,07
µ	Investmentfonds	241.028	0,03
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	12.140.835	1,60
Anlagen insgesamt		**689.815.647**	**90,79**

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Aktien 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)		
	US-Dollar		
1.792	GTT Communications Inc	22.512	0,00
	Aktien insgesamt *	**22.512**	**0,00**

Kapitalbetrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Schatzwechsel 10,95 % (31. Dezember 2022: 0,61 %)				
	US-Dollar				
121.655.000	United States Treasury Bill	0,00 %	11.01.2024	121.496.184	6,01
20.275.000	United States Treasury Bill	0,00 %	22.02.2024	20.124.424	1,00
50.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	14.03.2024	49.481.650	2,45
30.410.000	United States Treasury Bill	0,00 %	21.03.2024	30.063.872	1,49
	Schatzwechsel insgesamt **			**221.166.130**	**10,95**
	Agency Bonds 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,06 %)				
	US-Dollar				
690.000	Federal National Mortgage Association	5,63 %	15.07.2037	781.434	0,04
	Agency Bonds insgesamt **			**781.434**	**0,04**
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 10,45 % (31. Dezember 2022: 7,97 %)				
	US-Dollar				
3.599.000	Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC Class B	3,55 %	22.09.2025	3.543.227	0,18
3.110.000	BXP Trust 2017-GM Class A	3,38 %	13.06.2039	2.894.154	0,14
1.470.076	Carlyle Global Market Strategies CLO 2014-5 Ltd Series 2014-5X Class A1RR	6,72 %	15.07.2031	1.474.224	0,07
1.026.597	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-375P Class A	3,25 %	10.05.2035	969.829	0,05
19.510.509	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC25 Class XA	0,94 %	10.10.2047	61.185	0,00
14.296.768	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27 Class XA	1,30 %	10.02.2048	129.617	0,01
970.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8 Class C	4,26 %	15.09.2050	820.088	0,04
1.975.000	COMM 2013-CCRE8 Mortgage Trust Class D	3,60 %	10.06.2046	1.798.019	0,09
5.140.378	COMM 2014-CCRE16 Mortgage Trust Class XA	0,92 %	10.04.2047	2.175	0,00
7.494.288	COMM 2014-CCRE17 Mortgage Trust Class XA	0,87 %	10.05.2047	1.024	0,00
2.300.000	COMM 2014-CCRE21 Mortgage Trust Class AM	3,99 %	10.12.2047	2.185.393	0,11
10.643.710	COMM 2014-LC15 Mortgage Trust Class XA	0,00 %	10.04.2047	685	0,00
1.675.846	COMM 2014-UBS3 Mortgage Trust Class XA	1,04 %	10.06.2047	354	0,00
12.559.941	COMM 2014-UBS6 Mortgage Trust Class XA	0,82 %	10.12.2047	48.687	0,00
629.000	COMM 2015-CCRE24 Mortgage Trust Class B	4,35 %	10.08.2048	590.052	0,03
1.880.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01 Class 1B1	8,70 %	25.01.2040	1.904.466	0,09
5.101.348	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01 Class 1B1	8,44 %	25.10.2041	5.151.715	0,26
4.175.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03 Class 1B1	8,09 %	25.12.2041	4.193.434	0,21
4.538.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1B1	8,49 %	25.12.2041	4.579.112	0,23

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 10,45 % (31. Dezember 2022: 7,97 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
3.725.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01 Class 1M2	7,24 %	25.12.2041	3.736.641	0,18
2.558.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2B1	9,84 %	25.01.2042	2.639.616	0,13
1.855.652	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02 Class 2M2	8,34 %	25.01.2042	1.883.609	0,09
5.195.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R03 Class 1M2	8,84 %	25.03.2042	5.437.883	0,27
2.119.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04 Class 1M2	8,44 %	25.03.2042	2.190.499	0,11
609.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R08 Class 1M2	8,94 %	25.07.2042	639.515	0,03
753.000	CSAIL 2018-C14 Commercial Mortgage Trust Class C	4,90 %	15.11.2051	601.269	0,03
1.409.000	Eleven Madison Trust 2015-11MD Mortgage Trust Class A	3,55 %	10.09.2035	1.268.985	0,06
6.500.000	Empower CLO 2023-3 Ltd Series 2023-3X Class A	7,19 %	20.01.2037	6.501.278	0,32
4.689.477	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1M2	7,80 %	25.01.2031	4.804.862	0,24
1.031.468	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	7,65 %	25.08.2030	1.047.103	0,05
3.500.682	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	8,00 %	25.12.2030	3.599.102	0,18
3.859.928	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 2M2	8,25 %	25.02.2030	3.987.728	0,20
3.397.404	Fannie Mae Interest Strip Class C24	4,00 %	25.08.2043	627.323	0,03
2.633.389	Fannie Mae Interest Strip Class C26	4,00 %	25.10.2041	465.628	0,02
5.980.619	Fannie Mae REMICS Class AI	3,50 %	25.11.2051	1.004.070	0,05
2.870.601	Fannie Mae REMICS Class DS	0,70 %	25.06.2043	382.984	0,02
1.825.365	Fannie Mae REMICS Class HS	0,55 %	25.06.2046	237.204	0,01
3.059.368	Fannie Mae REMICS Class SA	0,55 %	25.09.2046	364.474	0,02
1.734.596	Fannie Mae REMICS Class SB	0,65 %	25.03.2046	182.141	0,01
2.770.014	Fannie Mae REMICS Class SN	0,65 %	25.07.2049	323.690	0,02
3.015.370	Fannie Mae REMICS Class ST	0,65 %	25.12.2044	357.936	0,02
3.005.606	Fannie Mae REMICS Class SY	0,70 %	25.07.2043	377.381	0,02
1.829.834	Freddie Mac REMICS Class BI	4,50 %	25.02.2050	360.930	0,02
1.684.266	Freddie Mac REMICS Class EC	1,50 %	25.02.2049	1.348.553	0,07
1.689.018	Freddie Mac REMICS Class LI	4,00 %	25.12.2048	313.493	0,02
1.031.817	Freddie Mac REMICS Class SA	0,55 %	15.10.2046	138.239	0,01
1.485.861	Freddie Mac REMICS Class SA	0,70 %	15.03.2045	188.423	0,01
2.489.445	Freddie Mac REMICS Class SP	0,70 %	15.01.2043	251.126	0,01
2.581.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6 Class B1	8,74 %	25.10.2041	2.627.434	0,13
4.261.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7 Class B1	8,99 %	25.11.2041	4.347.895	0,22
3.695.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA4 Class B1	9,09 %	25.12.2041	3.698.325	0,18
6.883.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA1 Class M2	7,84 %	25.01.2042	6.883.825	0,34
3.673.038	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2 Class M2	9,09 %	25.02.2042	3.799.660	0,19
3.749.162	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3 Class M1B	8,24 %	25.04.2042	3.857.084	0,19
963.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5 Class M1B	9,84 %	25.06.2042	1.038.881	0,05
2.373.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M1B	8,84 %	25.03.2042	2.461.222	0,12
4.211.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1 Class M2	10,59 %	25.03.2042	4.499.459	0,22
2.635.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA3 Class M1B	8,89 %	25.08.2042	2.730.339	0,14

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 10,45 % (31. Dezember 2022: 7,97 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.033.831	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes Class M2	7,25 %	25.07.2030	1.040.934	0,05
4.494.726	Government National Mortgage Association Class AB	1,00 %	20.07.2050	3.447.097	0,17
9.316.913	Government National Mortgage Association Class CI	2,00 %	20.10.2050	1.052.841	0,05
7.269.560	Government National Mortgage Association Class DI	2,50 %	20.02.2051	994.306	0,05
3.303.686	Government National Mortgage Association Class HE	2,00 %	20.06.2051	2.743.487	0,14
7.363.891	Government National Mortgage Association Class HS	0,73 %	20.10.2045	947.617	0,05
4.880.710	Government National Mortgage Association Class IE	3,50 %	20.08.2051	822.545	0,04
6.629.979	Government National Mortgage Association Class IO	2,50 %	20.11.2051	909.762	0,04
3.752.094	Government National Mortgage Association Class KA	1,00 %	20.08.2050	2.873.638	0,14
2.463.656	Government National Mortgage Association Class KS	0,73 %	20.07.2047	313.971	0,02
3.330.027	Government National Mortgage Association Class NC	1,50 %	20.07.2051	2.725.233	0,13
1.541.688	Government National Mortgage Association Class SA	0,63 %	16.12.2043	181.785	0,01
3.555.619	Government National Mortgage Association Class WK	1,00 %	20.06.2050	2.723.210	0,13
1.898.408	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC18 Class XA	0,81 %	10.01.2047	94	0,00
9.930.622	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26 Class XA	0,99 %	10.11.2047	45.552	0,00
9.721.261	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30 Class XA	0,72 %	10.05.2050	67.532	0,00
2.110.000	GS Mortgage Securities Trust 2015-GS1 Class AS	4,04 %	10.11.2048	1.899.273	0,09
2.514.000	GS Mortgage Securities Trust 2016-GS4 Class B	3,85 %	10.11.2049	2.243.137	0,11
2.996.112	Hilton Grand Vacations Trust 2018-A Class A	3,54 %	25.02.2032	2.916.731	0,14
1.748.000	Hilton USA Trust 2016-HHV Class C	4,19 %	05.11.2038	1.659.877	0,08
1.914.000	Hilton USA Trust 2016-HHV Class D	4,19 %	05.11.2038	1.794.579	0,09
1.425.000	Hilton USA Trust 2016-HHV Class E	4,19 %	05.11.2038	1.319.281	0,07
7.000.000	HPS Loan Management 2023-17 Ltd Series 2023-17X Class A	7,22 %	23.04.2036	7.045.637	0,35
1.800.000	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust Class C	2,98 %	10.08.2038	1.636.212	0,08
500.000	Hudson Yards 2016-10HY Mortgage Trust Class E	2,98 %	10.08.2038	440.229	0,02
2.775.000	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE Class A	2,85 %	06.09.2038	2.565.729	0,13
1.135.000	JP Morgan Mortgage Trust 2023-HE3 Class M1	7,44 %	25.05.2054	1.137.837	0,06
321.000	JP Morgan Mortgage Trust 2023-HE3 Class M2	7,84 %	25.05.2054	321.803	0,02
439.256	Laurel Road Prime Student Loan Trust 2017-B Class BFX	3,02 %	25.08.2042	428.551	0,02
890.415	Magnetite VII Ltd Series 2012-7X Class A1R2	6,38 %	15.01.2028	890.280	0,04
2.433.000	MetroNet Infrastructure Issuer LLC Class A2	6,35 %	20.10.2052	2.397.369	0,12
1.200.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Securities Trust 2017-C33 Class C	4,56 %	15.05.2050	1.043.427	0,05
2.726.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-H1 Class C	4,28 %	15.06.2050	2.278.285	0,11
2.340.000	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-H4 Class C	5,06 %	15.12.2051	1.965.634	0,10
2.447.239	OBX Trust Series 2023-NQM7 Class A1	6,84 %	25.04.2063	2.496.543	0,12
4.079.817	OCP CLO 2014-5 Ltd Class A1R	6,72 %	26.04.2031	4.081.289	0,20
469.338	Octagon Investment Partners 35 Ltd Series 2018-1X Class A1A	6,64 %	20.01.2031	469.655	0,02
3.337.000	OneMain Financial Issuance Trust 2022-2 Class A	4,89 %	14.10.2034	3.296.798	0,16
98.419	Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2004-DO1 Class M1	6,45 %	25.07.2034	102.903	0,01
2.490.000	Shops at Crystals Trust 2016-CSTL Class A	3,13 %	05.07.2036	2.324.413	0,12

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 10,45 % (31. Dezember 2022: 7,97 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
99.126	SoFi Professional Loan Program 2017-D LLC Class A2FX	2,65 %	25.09.2040	95.427	0,00
1.007.755	SoFi Professional Loan Program 2017-E LLC Class B	3,49 %	26.11.2040	970.579	0,05
900.000	Sofi Professional Loan Program 2017-F LLC Class BFX	3,62 %	25.01.2041	817.681	0,04
3.000.000	Sofi Professional Loan Program 2018-A LLC Class B	3,61 %	25.02.2042	2.739.253	0,14
650.000	Sofi Professional Loan Program 2018-D Trust Class BFX	4,14 %	25.02.2048	593.405	0,03
4.334.828	Taco Bell Funding LLC Class A2II	4,94 %	25.11.2048	4.232.253	0,21
7.000.000	Trinitas CLO XXIII Ltd Series 2023-23X Class A	7,12 %	20.10.2036	7.014.474	0,35
5.984.450	Voya CLO 2014-1 Ltd Series 2014-1X Class	6,55 %	18.04.2031	5.978.242	0,30
3.320.000	Wellington Management CLO 1 Ltd Series 2023-1X Class A	7,12 %	20.10.2036	3.325.609	0,16
1.941.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS4 Class C	4,68 %	15.12.2048	1.784.374	0,09
1.189.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class B	3,81 %	15.11.2049	1.071.250	0,05
3.175.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS6 Class C	4,39 %	15.11.2049	2.769.022	0,14
425.000	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C47 Class C	4,92 %	15.09.2061	360.481	0,02
8.186.983	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21 Class XA	0,98 %	15.08.2047	39.392	0,00
14.357.361	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22 Class XA	0,76 %	15.09.2057	42.057	0,00
1.463.303	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14 Class XA	1,13 %	15.03.2047	93	0,00
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **			**211.031.917**	**10,45**
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %)				
	Euro				
179.000	888 Acquisitions Ltd**	7,56 %	15.07.2027	189.278	0,01
2.400.000	Abertis Infraestructuras Finance BV*	3,25 %	29.12.2049	2.551.476	0,13
100.000	Accor SA*	7,25 %	29.12.2049	120.457	0,01
74.727	Adient Global Holdings Ltd*	3,50 %	15.08.2024	81.963	0,00
385.000	Allwyn International AS**	3,88 %	15.02.2027	410.405	0,02
440.000	Altice Financing SA**	4,25 %	15.08.2029	432.673	0,02
189.000	Altice France Holding SA*	4,00 %	15.02.2028	93.082	0,00
620.000	Altice France SA**	4,13 %	15.01.2029	549.312	0,03
100.000	Altice France SA**	4,25 %	15.10.2029	88.312	0,00
100.000	APA Infrastructure Ltd*	7,13 %	09.11.2083	116.277	0,01
469.000	Aramark International Finance Sarl*	3,13 %	01.04.2025	516.932	0,03
246.000	Assemblin Group AB**	8,96 %	05.07.2029	276.437	0,01
943.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd*	1,63 %	11.03.2081	942.759	0,05
210.000	Avantor Funding Inc*	3,88 %	15.07.2028	227.857	0,01
240.000	Avis Budget Finance Plc**	7,25 %	31.07.2030	284.614	0,01
1.987.000	Banijay Entertainment SASU**	7,00 %	01.05.2029	2.320.883	0,11
2.200.000	Bayer AG*	5,38 %	25.03.2082	2.315.992	0,11
1.700.000	Bayer AG*	6,63 %	25.09.2083	1.918.524	0,09
100.000	Bayer AG*	7,00 %	25.09.2083	114.314	0,01
300.000	BCP V Modular Services Finance II Plc**	4,75 %	30.11.2028	308.820	0,02

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
168.000	Benteler International AG*	9,38 %	15.05.2028	198.715	0,01
1.900.000	Birkenstock Financing Sarl*	5,25 %	30.04.2029	2.093.250	0,10
162.000	Boels Topholding BV**	6,25 %	15.02.2029	187.461	0,01
400.000	CECONOMY AG*	1,75 %	24.06.2026	385.069	0,02
415.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH**	4,38 %	15.01.2028	448.013	0,02
234.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH*	7,50 %	15.05.2030	276.043	0,01
547.000	Cirsa Finance International Sarl*	4,50 %	15.03.2027	583.221	0,03
1.642.000	Cirsa Finance International Sarl*	7,88 %	31.07.2028	1.897.224	0,09
200.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co**	4,38 %	15.05.2026	219.814	0,01
325.000	Coty Inc**	3,88 %	15.04.2026	359.113	0,02
185.000	Ctec II GmbH**	5,25 %	15.02.2030	183.623	0,01
1.542.000	Dana Financing Luxembourg Sarl*	8,50 %	15.07.2031	1.868.596	0,09
400.000	Deutsche Lufthansa AG*	3,00 %	29.05.2026	431.040	0,02
300.000	Deutsche Lufthansa AG*	3,75 %	11.02.2028	327.691	0,02
210.000	Douglas GmbH*	6,00 %	08.04.2026	229.873	0,01
2.206.000	Dufry One BV*	3,38 %	15.04.2028	2.330.922	0,12
500.000	EDP - Energias de Portugal SA*	5,94 %	23.04.2083	574.711	0,03
371.000	eircom Finance DAC**	3,50 %	15.05.2026	399.588	0,02
800.000	Electricite de France SA*	2,63 %	29.12.2049	788.345	0,04
2.600.000	Electricite de France SA*	7,50 %	29.12.2049	3.142.784	0,16
1.900.000	Elia Group SA*	5,85 %	29.12.2049	2.138.335	0,11
151.000	Emerald Debt Merger Sub LLC**	6,38 %	15.12.2030	178.821	0,01
186.000	Enel SpA*	6,38 %	29.12.2049	215.313	0,01
373.000	Energia Group Roi Financeco DAC**	6,88 %	31.07.2028	428.753	0,02
427.000	Eroski S Coop*	10,63 %	30.04.2029	487.161	0,02
200.000	Fiber Bidco SpA*	11,00 %	25.10.2027	241.760	0,01
175.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,87 %	03.08.2027	198.917	0,01
200.000	Forvia SE*	2,63 %	15.06.2025	217.283	0,01
279.000	Forvia SE*	2,75 %	15.02.2027	295.649	0,01
360.000	Gruenenthal GmbH*	3,63 %	15.11.2026	393.364	0,02
390.000	Heimstaden Bostad AB*	3,25 %	29.12.2049	226.347	0,01
250.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	1,63 %	13.10.2031	175.193	0,01
2.258.000	IHO Verwaltungs GmbH*	3,88 %	15.05.2027	2.449.300	0,12
279.000	IHO Verwaltungs GmbH*	8,75 %	15.05.2028	336.525	0,02
600.000	Iliad Holding SASU**	5,13 %	15.10.2026	662.359	0,03
1.703.000	Iliad Holding SASU**	5,63 %	15.10.2028	1.893.277	0,09
100.000	INEOS Finance Plc*	2,88 %	01.05.2026	107.385	0,01
720.000	INEOS Finance Plc*	3,38 %	31.03.2026	782.568	0,04
1.030.000	INEOS Quattro Finance 1 Plc*	3,75 %	15.07.2026	1.101.445	0,05
200.000	Infineon Technologies AG*	2,88 %	29.12.2049	216.171	0,01

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
400.000	International Consolidated Airlines Group SA*	3,75 %	25.03.2029	428.343	0,02
199.000	Intrum AB*	3,00 %	15.09.2027	168.109	0,01
200.000	Intrum AB*	3,50 %	15.07.2026	188.087	0,01
157.000	IPD 3 BV*	8,00 %	15.06.2028	185.584	0,01
2.225.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50 %	15.07.2028	2.406.534	0,12
259.000	Kapla Holding SAS*	3,38 %	15.12.2026	277.658	0,01
100.000	Kapla Holding SAS*	9,47 %	15.07.2027	112.826	0,01
185.000	Koninklijke KPN NV*	6,00 %	29.12.2049	212.250	0,01
295.000	Kronos International Inc**	3,75 %	15.09.2025	313.601	0,02
208.000	LHMC Finco 2 Sarl*	7,25 %	02.10.2025	228.934	0,01
3.705.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	4.004.486	0,20
100.000	Lottomatica SpA**	7,93 %	15.12.2030	111.675	0,01
200.000	Loxam SAS*	5,75 %	15.07.2027	218.080	0,01
200.000	Loxam SAS*	6,38 %	15.05.2028	230.629	0,01
100.000	Loxam SAS*	6,38 %	31.05.2029	114.691	0,01
185.000	Lune Holdings Sarl**	5,63 %	15.11.2028	167.259	0,01
215.000	Monitchem HoldCo 3 SA*	8,75 %	01.05.2028	243.240	0,01
157.000	Motion Finco Sarl*	7,38 %	15.06.2030	177.711	0,01
195.000	Multiversity SRL*	8,20 %	30.10.2028	216.753	0,01
390.000	Nidda Healthcare Holding GmbH**	7,50 %	21.08.2026	444.942	0,02
275.000	Olympus Water US Holding Corp*	3,88 %	01.10.2028	279.248	0,01
100.000	Olympus Water US Holding Corp**	9,63 %	15.11.2028	118.743	0,01
1.007.000	Orsted AS*	5,25 %	29.12.2049	1.111.270	0,05
299.000	PEU Finance Plc*	7,25 %	01.07.2028	340.699	0,02
150.000	PLT VII Finance Sarl**	4,63 %	05.01.2026	165.203	0,01
360.000	Q-Park Holding I BV**	1,50 %	01.03.2025	390.495	0,02
159.000	Repsol International Finance BV*	4,25 %	29.12.2049	171.990	0,01
100.000	Schaeffler AG*	3,38 %	12.10.2028	107.265	0,01
460.000	SES SA*	2,88 %	29.12.2049	463.490	0,02
659.000	Southern Co*	1,88 %	15.09.2081	626.115	0,03
2.000.000	SSE Plc*	4,00 %	29.12.2049	2.146.434	0,11
874.000	Stedin Holding NV*	1,50 %	29.12.2049	869.702	0,04
217.000	Summer BC Holdco B Sarl**	5,75 %	31.10.2026	230.192	0,01
200.000	Synthomer Plc*	3,88 %	01.07.2025	219.052	0,01
373.659	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH**	6,00 %	30.07.2026	413.084	0,02
100.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH**	2,00 %	15.07.2025	108.314	0,01
200.000	Telecom Italia SpA**	3,00 %	30.09.2025	216.123	0,01
2.220.000	Telecom Italia SpA*	7,88 %	31.07.2028	2.730.441	0,13
400.000	Telefonica Europe BV*	6,75 %	29.12.2049	472.824	0,02
200.000	Telefonica Europe BV*	7,13 %	29.12.2049	239.063	0,01

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
1.085.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	3,75 %	09.05.2027	1.157.936	0,06
1.863.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	4,38 %	09.05.2030	1.937.299	0,10
2.080.000	TK Elevator Midco GmbH**	4,38 %	15.07.2027	2.228.997	0,11
700.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE*	7,25 %	29.12.2049	775.152	0,04
200.000	United Group BV**	4,63 %	15.08.2028	209.997	0,01
300.000	Valeo SE*	5,38 %	28.05.2027	344.698	0,02
100.000	Valeo SE*	5,88 %	12.04.2029	118.722	0,01
945.000	Verisure Holding AB*	3,88 %	15.07.2026	1.027.029	0,05
1.826.000	Verisure Midholding AB*	5,25 %	15.02.2029	1.930.974	0,10
1.100.000	Vodafone Group Plc*	6,50 %	30.08.2084	1.302.609	0,06
2.100.000	Volkswagen International Finance NV*	3,75 %	29.12.2049	2.180.707	0,11
284.000	WEPA Hygieneprodukte GmbH**	2,88 %	15.12.2027	294.529	0,01
300.000	Wintershall Dea Finance 2 BV*	3,00 %	29.12.2049	290.261	0,01
220.000	Wp/ap Telecom Holdings III BV**	5,50 %	15.01.2030	222.588	0,01
2.400.000	ZF Europe Finance BV*	3,00 %	23.10.2029	2.447.352	0,12
300.000	ZF Finance GmbH*	3,75 %	21.09.2028	320.525	0,02
634.000	Ziggo Bond Co BV*	3,38 %	28.02.2030	593.289	0,03
	Euro insgesamt			**82.785.192**	**4,10**
	Britisches Pfund				
200.000	AA Bond Co Ltd*	6,50 %	31.01.2026	243.582	0,01
160.000	AA Bond Co Ltd 144A*	6,50 %	31.01.2026	194.866	0,01
1.138.000	AA Bond Co Ltd*	8,45 %	31.01.2028	1.524.290	0,08
320.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc*	4,75 %	15.07.2027	297.643	0,01
1.569.000	B&M European Value Retail SA*	8,13 %	15.11.2030	2.134.922	0,11
1.989.000	Bellis Acquisition Co Plc**	3,25 %	16.02.2026	2.359.942	0,12
205.000	Bellis Finco Plc**	4,00 %	16.02.2027	228.244	0,01
2.386.000	British Telecommunications Plc*	8,38 %	20.12.2083	3.219.513	0,16
200.000	Castle UK Finco Plc**	7,00 %	15.05.2029	217.285	0,01
320.000	Centrica Plc*	5,25 %	10.04.2075	403.868	0,02
130.000	Constellation Automotive Financing Plc*	4,88 %	15.07.2027	136.742	0,01
200.000	Co-operative Group Holdings 2011 Ltd*	7,50 %	08.07.2026	252.230	0,01
235.000	CPUK Finance Ltd**	6,50 %	28.08.2026	290.546	0,01
525.000	Encore Capital Group Inc*	4,25 %	01.06.2028	575.116	0,03
1.491.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC/GTCR W Dutch Finance Sub BV**	8,50 %	15.01.2031	2.060.863	0,10
100.000	Iceland Bondco Plc**	10,88 %	15.12.2027	133.410	0,01
200.000	Maison Finco Plc**	6,00 %	31.10.2027	221.302	0,01
340.000	Mobico Group Plc*	4,25 %	29.12.2049	383.815	0,02
155.000	NGG Finance Plc*	5,63 %	18.06.2073	195.334	0,01
200.000	Pinewood Finance Co Ltd**	3,25 %	30.09.2025	248.444	0,01

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	Britisches Pfund (Fortsetzung)				
273.000	Pinnacle Bidco Plc*	10,00 %	11.10.2028	362.595	0,02
165.000	RAC Bond Co Plc**	5,25 %	04.11.2027	184.631	0,01
400.000	Rolls-Royce Plc*	5,75 %	15.10.2027	513.107	0,02
200.000	TVL Finance Plc**	10,25 %	28.04.2028	265.647	0,01
1.700.000	Vattenfall AB*	6,88 %	17.08.2083	2.184.159	0,11
1.045.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC**	4,88 %	15.07.2028	1.229.475	0,06
264.000	Vodafone Group Plc*	4,88 %	03.10.2078	327.943	0,02
	Britisches Pfund insgesamt			**20.389.514**	**1,01**
	US-Dollar				
730.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	3,88 %	15.01.2028	690.177	0,03
515.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	4,00 %	15.10.2030	462.536	0,02
310.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc**	4,38 %	15.01.2028	296.357	0,01
2.000.000	ABN AMRO Bank NV**	3,32 %	13.03.2037	1.601.906	0,08
660.000	ADT Security Corp**	4,88 %	15.07.2032	611.223	0,03
471.000	AerCap Global Aviation Trust*	6,50 %	15.06.2045	472.267	0,02
2.905.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust*	3,30 %	30.01.2032	2.529.318	0,13
360.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	3,50 %	15.03.2029	327.295	0,02
580.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	4,88 %	15.02.2030	555.882	0,03
920.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC**	5,88 %	15.02.2028	921.192	0,05
695.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.10.2027	693.262	0,03
685.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	6,75 %	15.04.2028	701.204	0,03
205.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer**	7,00 %	15.01.2031	216.375	0,01
470.000	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl 144A**	4,63 %	01.06.2028	430.045	0,02
1.838.000	Ally Financial Inc**	4,70 %	29.12.2049	1.251.600	0,06
1.745.000	Ally Financial Inc Series B**	4,70 %	29.12.2049	1.314.311	0,07
1.210.000	Altice France Holding SA**	6,00 %	15.02.2028	582.257	0,03
1.130.000	Altice France SA*	5,50 %	15.01.2028	931.533	0,05
355.000	American Airlines Inc**	7,25 %	15.02.2028	359.382	0,02
1.387.500	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,50 %	20.04.2026	1.378.511	0,07
1.765.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd**	5,75 %	20.04.2029	1.722.477	0,09
1.250.000	American Express Co**	3,55 %	29.12.2049	1.074.750	0,05
1.975.000	American Express Co**	5,63 %	28.07.2034	2.042.139	0,10
2.495.000	Amgen Inc**	2,77 %	01.09.2053	1.603.181	0,08
1.745.000	Amgen Inc**	5,75 %	02.03.2063	1.832.945	0,09
495.000	AmWINS Group Inc**	4,88 %	30.06.2029	452.707	0,02
995.000	APX Group Inc**	5,75 %	15.07.2029	928.871	0,05
310.000	Aramark Services Inc**	5,00 %	01.02.2028	300.920	0,02
660.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc**	6,00 %	15.06.2027	658.048	0,03
430.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc**	5,25 %	15.08.2027	334.557	0,02

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
875.000	Ascension Health**	3,11 %	15.11.2039	687.358	0,03
615.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	5,88 %	30.06.2029	572.828	0,03
395.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	7,00 %	01.11.2026	398.098	0,02
910.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp**	8,25 %	31.12.2028	916.353	0,05
680.000	ASGN Inc**	4,63 %	15.05.2028	646.426	0,03
515.000	AssuredPartners Inc**	5,63 %	15.01.2029	481.349	0,02
895.000	AssuredPartners Inc**	7,00 %	15.08.2025	897.468	0,04
3.875.000	AT&T Inc**	3,50 %	15.09.2053	2.815.306	0,14
720.000	AthenaHealth Group Inc**	6,50 %	15.02.2030	654.129	0,03
2.950.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd**	5,67 %	03.10.2025	2.997.086	0,15
417.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd*	6,75 %	29.12.2049	420.058	0,02
600.000	Avient Corp**	7,13 %	01.08.2030	624.539	0,03
1.245.000	Ball Corp*	2,88 %	15.08.2030	1.069.623	0,05
310.000	Ball Corp*	3,13 %	15.09.2031	267.620	0,01
1.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA*	6,50 %	29.12.2049	984.043	0,05
800.000	Banco do Brasil SA*	6,25 %	29.12.2049	782.584	0,04
2.000.000	Banco Santander SA*	5,15 %	18.08.2025	1.989.168	0,10
1.200.000	Banco Santander SA*	7,50 %	29.12.2049	1.200.733	0,06
3.320.000	Bank of America Corp**	2,97 %	04.02.2033	2.826.074	0,14
213.000	Bank of America Corp**	4,30 %	29.12.2049	201.049	0,01
1.690.000	Bank of America Corp**	4,38 %	29.12.2049	1.510.397	0,07
1.915.000	Bank of America Corp**	4,95 %	22.07.2028	1.915.607	0,10
1.830.000	Bank of America Corp**	6,10 %	29.12.2049	1.817.205	0,09
2.130.000	Bank of Montreal**	5,30 %	05.06.2026	2.151.934	0,11
210.000	Bank of New York Mellon Corp**	3,70 %	29.12.2049	197.497	0,01
3.475.000	Bank of New York Mellon Corp**	3,75 %	29.12.2049	3.012.241	0,15
3.360.000	Bank of Nova Scotia*	5,35 %	07.12.2026	3.417.686	0,17
1.760.000	Barclays Plc*	4,38 %	29.12.2049	1.372.634	0,07
225.000	Barclays Plc*	6,13 %	29.12.2049	215.485	0,01
1.730.000	Barclays Plc*	6,69 %	13.09.2034	1.850.696	0,09
1.740.000	Barclays Plc*	8,00 %	29.12.2049	1.712.007	0,08
1.530.000	Barclays Plc*	9,63 %	29.12.2049	1.593.112	0,08
590.000	Bath & Body Works Inc**	6,63 %	01.10.2030	603.388	0,03
420.000	Bath & Body Works Inc*	6,75 %	01.07.2036	423.230	0,02
1.085.000	BCPE Empire Holdings Inc**	7,63 %	01.05.2027	1.047.352	0,05
590.000	Beacon Roofing Supply Inc**	4,50 %	15.11.2026	575.361	0,03
460.000	Benteler International AG**	10,50 %	15.05.2028	484.944	0,02
815.000	Berry Global Inc**	5,63 %	15.07.2027	809.740	0,04
190.000	Blackstone Mortgage Trust Inc**	3,75 %	15.01.2027	169.162	0,01
235.000	BNP Paribas SA*	4,50 %	29.12.2049	187.654	0,01

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
270.000	BNP Paribas SA*	4,63 %	29.12.2049	218.154	0,01
464.000	BNP Paribas SA*	7,38 %	29.12.2049	465.805	0,02
470.000	BNP Paribas SA*	9,25 %	29.12.2049	503.756	0,03
890.000	BNP Paribas SA REG S*	4,63 %	29.12.2049	779.894	0,04
4.040.000	Boeing Co*	5,81 %	01.05.2050	4.186.456	0,21
4.750.000	BP Capital Markets Plc*	4,88 %	29.12.2049	4.526.382	0,22
1.115.000	BPCE SA**	3,65 %	14.01.2037	917.696	0,05
1.700.000	BPCE SA**	7,00 %	19.10.2034	1.849.642	0,09
1.695.000	BPCE SA 144A**	7,00 %	19.10.2034	1.844.202	0,09
235.000	Buckeye Partners LP**	5,85 %	15.11.2043	190.740	0,01
325.000	Builders FirstSource Inc**	4,25 %	01.02.2032	293.633	0,01
320.000	Builders FirstSource Inc**	6,38 %	15.06.2032	327.115	0,02
385.000	C&W Senior Financing DAC**	6,88 %	15.09.2027	359.086	0,02
595.000	Caesars Entertainment Inc**	4,63 %	15.10.2029	537.426	0,03
570.000	Caesars Entertainment Inc**	6,25 %	01.07.2025	571.980	0,03
765.000	Caesars Entertainment Inc**	8,13 %	01.07.2027	784.725	0,04
330.000	Callon Petroleum Co**	7,50 %	15.06.2030	333.162	0,02
340.000	Callon Petroleum Co**	8,00 %	01.08.2028	347.614	0,02
325.000	Calpine Corp**	3,75 %	01.03.2031	285.432	0,01
1.142.000	Calpine Corp**	4,63 %	01.02.2029	1.061.827	0,05
1.204.000	Calpine Corp**	5,00 %	01.02.2031	1.105.303	0,05
225.000	Calpine Corp**	5,13 %	15.03.2028	215.866	0,01
1.165.000	Camelot Return Merger Sub Inc**	8,75 %	01.08.2028	1.184.018	0,06
2.850.000	Capital One Financial Corp**	3,95 %	29.12.2049	2.291.226	0,11
865.000	Capital One Financial Corp**	6,38 %	08.06.2034	890.790	0,04
310.000	Carnival Corp**	4,00 %	01.08.2028	288.413	0,01
205.000	Carnival Corp**	7,00 %	15.08.2029	214.173	0,01
895.000	Carnival Corp**	7,63 %	01.03.2026	911.742	0,05
650.000	Carnival Corp**	9,88 %	01.08.2027	682.810	0,03
745.000	Carnival Holdings Bermuda Ltd**	10,38 %	01.05.2028	811.450	0,04
80.000	Carpenter Technology Corp*	6,38 %	15.07.2028	79.793	0,00
485.000	Carpenter Technology Corp*	7,63 %	15.03.2030	500.802	0,02
775.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,25 %	01.02.2031	678.323	0,03
480.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,25 %	15.01.2034	390.704	0,02
325.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,50 %	01.05.2032	278.782	0,01
335.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,50 %	01.06.2033	283.892	0,01
375.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,75 %	01.03.2030	343.200	0,02
985.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	4,75 %	01.02.2032	869.854	0,04
550.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp**	5,00 %	01.02.2028	526.659	0,03
503.000	CDW LLC/CDW Finance Corp**	3,57 %	01.12.2031	446.760	0,02

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
190.000	Cedar Fair LP**	5,25 %	15.07.2029	179.466	0,01
625.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op*	5,38 %	15.04.2027	612.544	0,03
440.000	Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co/Magnum Management Corp/Millennium Op**	5,50 %	01.05.2025	438.063	0,02
2.804.000	Charles Schwab Corp**	4,00 %	29.12.2049	2.218.132	0,11
2.430.000	Charles Schwab Corp**	5,85 %	19.05.2034	2.509.662	0,12
725.000	Chart Industries Inc**	7,50 %	01.01.2030	758.710	0,04
315.000	Chart Industries Inc**	9,50 %	01.01.2031	342.405	0,02
3.710.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	3,90 %	01.06.2052	2.498.630	0,12
1.990.000	Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital**	4,80 %	01.03.2050	1.542.956	0,08
410.000	CHS/Community Health Systems Inc**	4,75 %	15.02.2031	322.875	0,02
275.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,25 %	15.05.2030	230.375	0,01
300.000	CHS/Community Health Systems Inc**	5,63 %	15.03.2027	279.133	0,01
330.000	CHS/Community Health Systems Inc**	6,00 %	15.01.2029	297.419	0,01
282.000	CHS/Community Health Systems Inc**	8,00 %	15.12.2027	272.475	0,01
970.000	Churchill Downs Inc**	6,75 %	01.05.2031	985.700	0,05
1.650.000	Citigroup Inc**	4,15 %	29.12.2049	1.420.215	0,07
185.000	Citigroup Inc**	4,70 %	29.12.2049	172.528	0,01
152.000	Citigroup Inc**	5,00 %	29.12.2049	147.926	0,01
1.550.000	Citigroup Inc**	7,38 %	29.12.2049	1.572.624	0,08
393.000	Citizens Financial Group Inc**	6,38 %	29.12.2049	359.694	0,02
294.000	Citizens Financial Group Inc**	8,69 %	29.12.2049	259.991	0,01
395.000	Civitas Resources Inc**	8,38 %	01.07.2028	412.852	0,02
865.000	Civitas Resources Inc**	8,63 %	01.11.2030	918.255	0,05
460.000	Civitas Resources Inc**	8,75 %	01.07.2031	490.267	0,02
1.395.000	Comcast Corp**	2,94 %	01.11.2056	918.339	0,05
400.000	Commerzbank AG**	7,00 %	29.12.2049	386.098	0,02
845.000	CommonSpirit Health**	4,19 %	01.10.2049	713.262	0,04
3.830.000	Commonwealth Bank of Australia**	5,50 %	12.09.2025	3.879.717	0,19
565.000	CommScope Inc**	4,75 %	01.09.2029	379.875	0,02
395.000	CommScope Inc**	8,25 %	01.03.2027	208.919	0,01
640.000	CommScope Technologies LLC**	5,00 %	15.03.2027	266.998	0,01
1.510.000	Comstock Resources Inc**	6,75 %	01.03.2029	1.382.816	0,07
2.685.000	Constellation Brands Inc*	2,25 %	01.08.2031	2.257.761	0,11
960.000	Constellation Energy Generation LLC**	6,50 %	01.10.2053	1.084.555	0,05
1.425.000	Corebridge Financial Inc**	4,35 %	05.04.2042	1.210.628	0,06
1.975.000	Corebridge Financial Inc*	5,75 %	15.01.2034	2.020.264	0,10
350.000	Cornerstone Building Brands Inc**	6,13 %	15.01.2029	287.359	0,01
1.350.000	Corp Nacional del Cobre de Chile*	3,15 %	14.01.2030	1.207.140	0,06
655.000	Coty Inc**	5,00 %	15.04.2026	645.062	0,03
150.000	Coty Inc**	6,50 %	15.04.2026	149.930	0,01

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
565.000	Country Garden Holdings Co Ltd**	4,80 %	06.08.2030	47.567	0,00
1.035.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	5,50 %	15.06.2031	982.225	0,05
260.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC**	7,50 %	15.12.2033	269.760	0,01
1.289.000	Crown Castle Towers LLC†	3,66 %	15.05.2025	1.251.190	0,06
1.675.000	Crown Castle Towers LLC**	4,24 %	15.07.2028	1.590.649	0,08
590.000	CSC Holdings LLC**	4,13 %	01.12.2030	449.533	0,02
695.000	CSC Holdings LLC**	4,63 %	01.12.2030	419.342	0,02
400.000	CSC Holdings LLC**	5,25 %	01.06.2024	391.856	0,02
1.180.000	CSC Holdings LLC**	5,75 %	15.01.2030	735.777	0,04
280.000	CSC Holdings LLC**	6,50 %	01.02.2029	247.351	0,01
580.000	CSC Holdings LLC**	7,50 %	01.04.2028	434.446	0,02
305.000	CSC Holdings LLC**	11,25 %	15.05.2028	314.475	0,02
1.290.000	CSN Inova Ventures**	6,75 %	28.01.2028	1.261.376	0,06
4.400.000	CVS Health Corp*	5,05 %	25.03.2048	4.119.167	0,20
2.012.000	Discover Financial Services**	5,50 %	29.12.2049	1.624.187	0,08
2.480.000	Discovery Communications LLC**	4,65 %	15.05.2050	1.995.220	0,10
775.000	DISH DBS Corp**	5,13 %	01.06.2029	400.229	0,02
565.000	Dominion Energy Inc**	4,35 %	29.12.2049	503.819	0,03
1.000.000	DT Midstream Inc**	4,13 %	15.06.2029	921.163	0,05
310.000	DT Midstream Inc**	4,38 %	15.06.2031	280.020	0,01
500.000	Ecopetrol SA**	5,88 %	28.05.2045	395.507	0,02
1.995.000	Edison International**	5,00 %	29.12.2049	1.862.539	0,09
360.000	Emerald Debt Merger Sub LLC**	6,63 %	15.12.2030	368.143	0,02
870.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13 %	29.12.2049	866.233	0,04
1.600.000	Enbridge Inc**	8,25 %	15.01.2084	1.654.923	0,08
500.000	Encompass Health Corp*	4,75 %	01.02.2030	471.413	0,02
535.000	Energizer Holdings Inc**	4,38 %	31.03.2029	479.534	0,02
105.000	Energy Transfer LP**	7,38 %	01.02.2031	110.414	0,01
370.000	EQM Midstream Partners LP**	4,50 %	15.01.2029	349.885	0,02
370.000	EQM Midstream Partners LP**	4,75 %	15.01.2031	344.836	0,02
480.000	EQM Midstream Partners LP*	5,50 %	15.07.2028	475.901	0,02
400.000	EQM Midstream Partners LP**	6,00 %	01.07.2025	400.066	0,02
160.000	EQM Midstream Partners LP**	6,50 %	01.07.2027	163.017	0,01
375.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2027	386.633	0,02
290.000	EQM Midstream Partners LP**	7,50 %	01.06.2030	312.086	0,02
1.200.000	EquipmentShare.com Inc**	9,00 %	15.05.2028	1.236.120	0,06
830.000	Fifth Third Bancorp**	1,71 %	01.11.2027	747.435	0,04
2.020.000	Fifth Third Bancorp**	4,34 %	25.04.2033	1.879.142	0,09
531.000	Fifth Third Bancorp**	8,62 %	29.12.2049	509.498	0,03
250.000	First Quantum Minerals Ltd**	6,88 %	01.03.2026	224.111	0,01

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
230.000	First Quantum Minerals Ltd**	7,50 %	01.04.2025	219.513	0,01
400.000	First Quantum Minerals Ltd**	8,63 %	01.06.2031	339.500	0,02
470.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	4,50 %	15.09.2027	452.079	0,02
460.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd**	6,13 %	15.04.2032	463.953	0,02
325.000	Ford Motor Co*	3,25 %	12.02.2032	270.440	0,01
1.575.000	Ford Motor Co*	5,29 %	08.12.2046	1.389.449	0,07
425.000	Ford Motor Co*	9,63 %	22.04.2030	501.217	0,03
310.000	Ford Motor Credit Co LLC*	2,90 %	10.02.2029	271.747	0,01
365.000	Ford Motor Credit Co LLC*	3,38 %	13.11.2025	349.445	0,02
80.000	Ford Motor Credit Co LLC*	4,39 %	08.01.2026	77.842	0,00
360.000	Ford Motor Credit Co LLC*	5,11 %	03.05.2029	350.406	0,02
185.000	Ford Motor Credit Co LLC*	6,80 %	12.05.2028	193.358	0,01
265.000	Ford Motor Credit Co LLC*	7,20 %	10.06.2030	282.529	0,01
55.000	Ford Motor Credit Co LLC*	7,35 %	04.11.2027	58.038	0,00
1.735.000	Fox Corp**	6,50 %	13.10.2033	1.879.134	0,09
370.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,00 %	01.05.2028	342.286	0,02
605.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88 %	15.10.2027	584.993	0,03
500.000	Frontier Communications Holdings LLC**	5,88 %	01.11.2029	423.064	0,02
330.000	Frontier Communications Holdings LLC**	8,75 %	15.05.2030	339.738	0,02
175.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00 %	15.12.2025	179.588	0,01
300.000	Garda World Security Corp**	7,75 %	15.02.2028	310.689	0,02
340.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	6,25 %	15.05.2026	339.919	0,02
380.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	7,75 %	01.02.2028	381.716	0,02
250.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp*	8,00 %	15.01.2027	254.326	0,01
845.000	Georgetown University**	2,94 %	01.04.2050	583.504	0,03
190.000	GFL Environmental Inc**	6,75 %	15.01.2031	195.991	0,01
940.000	Gilead Sciences Inc**	5,25 %	15.10.2033	980.188	0,05
460.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,65 %	29.12.2049	409.064	0,02
570.000	Goldman Sachs Group Inc**	3,80 %	29.12.2049	508.318	0,03
565.000	Goldman Sachs Group Inc**	4,13 %	29.12.2049	503.867	0,03
990.000	Goldman Sachs Group Inc**	6,56 %	24.10.2034	1.088.350	0,05
505.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00 %	31.05.2026	497.541	0,02
1.005.000	Goodyear Tire & Rubber Co**	5,00 %	15.07.2029	950.796	0,05
590.000	Grupo Aval Ltd*	4,38 %	04.02.2030	501.502	0,03
340.000	GTCR AP Finance Inc**	8,00 %	15.05.2027	343.913	0,02
625.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC**	7,50 %	15.01.2031	660.858	0,03
895.000	Harvest Midstream I LP**	7,50 %	01.09.2028	890.677	0,04
550.000	HB Fuller Co*	4,25 %	15.10.2028	514.901	0,03
1.480.000	HCA Inc*	5,50 %	01.06.2033	1.503.863	0,07
250.000	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co**	8,38 %	01.11.2033	265.246	0,01

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
630.000	HSBC Holdings Plc*	4,00 %	29.12.2049	579.617	0,03
560.000	HSBC Holdings Plc**	4,70 %	29.12.2049	457.489	0,02
2.415.000	HSBC Holdings Plc**	6,00 %	29.12.2049	2.312.510	0,11
781.000	HSBC Holdings Plc**	6,38 %	29.12.2049	772.111	0,04
980.000	HSBC Holdings Plc**	8,00 %	29.12.2049	1.011.152	0,05
310.000	HUB International Ltd**	7,00 %	01.05.2026	311.558	0,02
1.765.000	HUB International Ltd**	7,25 %	15.06.2030	1.865.437	0,09
1.355.000	Hudbay Minerals Inc**	4,50 %	01.04.2026	1.313.871	0,07
240.000	Hudbay Minerals Inc**	6,13 %	01.04.2029	235.635	0,01
124.000	Huntington Bancshares Inc**	4,45 %	29.12.2049	109.056	0,01
284.000	Huntington Bancshares Inc**	5,63 %	29.12.2049	257.828	0,01
613.000	Huntington Bancshares Inc**	8,54 %	29.12.2049	575.951	0,03
275.000	Iliad Holding SASU**	6,50 %	15.10.2026	274.659	0,01
215.000	Iliad Holding SASU**	7,00 %	15.10.2028	214.100	0,01
545.000	Imola Merger Corp**	4,75 %	15.05.2029	518.485	0,03
1.370.000	INEOS Finance Plc*	6,75 %	15.05.2028	1.347.021	0,07
2.358.000	ING Groep NV**	3,88 %	29.12.2049	1.918.822	0,10
1.202.000	ING Groep NV*	5,75 %	29.12.2049	1.123.111	0,06
859.000	ING Groep NV*	6,50 %	29.12.2049	838.128	0,04
280.000	Ingersoll Rand Inc*	5,40 %	14.08.2028	288.716	0,01
425.000	Ingersoll Rand Inc*	5,70 %	14.08.2033	449.853	0,02
1.325.000	Intesa Sanpaolo SpA**	7,78 %	20.06.2054	1.378.721	0,07
1.865.000	Intesa Sanpaolo SpA**	8,25 %	21.11.2033	2.025.331	0,10
675.000	Iron Mountain Inc**	5,25 %	15.03.2028	656.689	0,03
430.000	Iron Mountain Inc**	5,63 %	15.07.2032	408.077	0,02
295.000	Iron Mountain Information Management Services Inc**	5,00 %	15.07.2032	270.887	0,01
1.645.000	ITT Holdings LLC**	6,50 %	01.08.2029	1.456.919	0,07
560.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc**	7,75 %	15.10.2025	566.744	0,03
860.000	JELD-WEN Inc**	4,88 %	15.12.2027	813.603	0,04
2.715.000	JPMorgan Chase & Co**	2,18 %	01.06.2028	2.484.432	0,12
445.000	JPMorgan Chase & Co**	3,65 %	29.12.2049	408.347	0,02
936.000	JPMorgan Chase & Co**	4,60 %	29.12.2049	904.944	0,05
229.000	JPMorgan Chase & Co**	5,00 %	29.12.2049	224.967	0,01
133.000	JPMorgan Chase & Co**	8,22 %	29.12.2049	132.671	0,01
580.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,75 %	19.04.2047	509.876	0,03
270.000	KB Home*	4,00 %	15.06.2031	242.205	0,01
525.000	KB Home**	7,25 %	15.07.2030	544.091	0,03
1.865.000	Kinder Morgan Inc*	5,55 %	01.06.2045	1.797.412	0,09
440.000	Kinetik Holdings LP**	5,88 %	15.06.2030	432.244	0,02
915.000	L3Harris Technologies Inc*	5,40 %	15.01.2027	934.435	0,05

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.830.000	L3Harris Technologies Inc*	5,40 %	31.07.2033	1.903.574	0,09
1.460.000	L3Harris Technologies Inc*	5,60 %	31.07.2053	1.555.992	0,08
325.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2027	363.616	0,02
315.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2029	361.038	0,02
445.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC**	4,25 %	01.07.2029	388.174	0,02
245.000	Level 3 Financing Inc**	3,40 %	01.03.2027	234.198	0,01
530.000	Level 3 Financing Inc**	3,63 %	15.01.2029	269.283	0,01
265.000	Level 3 Financing Inc**	3,75 %	15.07.2029	130.842	0,01
340.000	Level 3 Financing Inc**	4,63 %	15.09.2027	205.486	0,01
455.000	Level 3 Financing Inc**	10,50 %	15.05.2030	434.695	0,02
485.000	Liberty Mutual Group Inc**	4,13 %	15.12.2051	407.330	0,02
750.000	Light & Wonder International Inc**	7,25 %	15.11.2029	768.668	0,04
580.000	Live Nation Entertainment Inc**	5,63 %	15.03.2026	575.224	0,03
620.000	Live Nation Entertainment Inc**	6,50 %	15.05.2027	631.251	0,03
1.895.000	Lloyds Banking Group Plc*	4,98 %	11.08.2033	1.847.044	0,09
110.000	Lloyds Banking Group Plc**	7,50 %	29.12.2049	107.997	0,01
1.315.000	Lloyds Banking Group Plc**	8,00 %	29.12.2049	1.320.915	0,07
964.000	Lloyds Banking Group Plc Series WI**	7,50 %	29.12.2049	955.669	0,05
1.835.000	M&T Bank Corp**	3,50 %	29.12.2049	1.351.233	0,07
595.000	Macy's Retail Holdings LLC*	4,50 %	15.12.2034	482.983	0,02
160.000	Macy's Retail Holdings LLC*	5,13 %	15.01.2042	125.028	0,01
540.000	Macy's Retail Holdings LLC**	5,88 %	15.03.2030	513.775	0,03
395.000	Manitowoc Co Inc**	9,00 %	01.04.2026	397.935	0,02
1.975.000	Marvell Technology Inc**	5,95 %	15.09.2033	2.095.819	0,10
830.000	Masonite International Corp**	3,50 %	15.02.2030	720.461	0,04
1.150.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	7,88 %	15.08.2026	1.171.368	0,06
625.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co**	9,25 %	15.04.2027	614.150	0,03
865.000	McAfee Corp**	7,38 %	15.02.2030	791.117	0,04
360.000	McGraw-Hill Education Inc**	5,75 %	01.08.2028	347.497	0,02
425.000	McGraw-Hill Education Inc**	8,00 %	01.08.2029	395.658	0,02
200.000	Medco Bell Pte Ltd**	6,38 %	30.01.2027	190.562	0,01
525.000	Medco Bell Pte Ltd 144A**	6,38 %	30.01.2027	500.226	0,02
1.460.000	Medline Borrower LP**	3,88 %	01.04.2029	1.321.817	0,07
355.000	Medline Borrower LP**	5,25 %	01.10.2029	335.090	0,02
915.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63 %	17.07.2027	858.377	0,04
215.000	Metinvest BV*	7,65 %	01.10.2027	139.880	0,01
900.000	Metinvest BV*	7,75 %	17.10.2029	551.588	0,03
1.815.000	Metropolitan Life Global Funding I**	5,00 %	06.01.2026	1.823.151	0,09
2.120.000	Midwest Gaming Borrower LLC/Midwest Gaming Finance Corp**	4,88 %	01.05.2029	1.973.943	0,10
1.020.000	Mizuho Financial Group Inc*	1,55 %	09.07.2027	932.531	0,05

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
430.000	Molina Healthcare Inc**	3,88 %	15.11.2030	387.014	0,02
790.000	Molina Healthcare Inc**	3,88 %	15.05.2032	691.174	0,03
3.070.000	Molson Coors Beverage Co*	4,20 %	15.07.2046	2.620.500	0,13
6.775.000	Morgan Stanley**	2,48 %	16.09.2036	5.373.230	0,27
2.895.000	Morgan Stanley**	5,25 %	21.04.2034	2.896.065	0,14
635.000	Morgan Stanley**	5,95 %	19.01.2038	642.448	0,03
875.000	Mount Sinai Hospital**	3,74 %	01.07.2049	665.139	0,03
320.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,00 %	15.10.2027	261.677	0,01
365.000	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp*	5,25 %	01.08.2026	326.705	0,02
266.099	MV24 Capital BV*	6,75 %	01.06.2034	249.285	0,01
405.000	Nabors Industries Inc**	7,38 %	15.05.2027	397.201	0,02
520.000	Nabors Industries Inc**	9,13 %	31.01.2030	522.561	0,03
4.640.000	NatWest Group Plc*	3,03 %	28.11.2035	3.852.892	0,19
1.580.000	NatWest Group Plc*	4,60 %	29.12.2049	1.189.621	0,06
525.000	NatWest Group Plc*	6,00 %	29.12.2049	508.887	0,03
470.000	NCL Corp Ltd**	5,88 %	15.02.2027	466.236	0,02
555.000	Neptune Bidco US Inc**	9,29 %	15.04.2029	517.991	0,03
1.210.000	New Fortress Energy Inc**	6,50 %	30.09.2026	1.163.183	0,06
585.000	New Fortress Energy Inc**	6,75 %	15.09.2025	580.800	0,03
2.400.000	New York Life Global Funding**	0,85 %	15.01.2026	2.219.301	0,11
355.000	Newfold Digital Holdings Group Inc**	6,00 %	15.02.2029	268.568	0,01
2.820.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc**	5,75 %	01.09.2025	2.847.789	0,14
2.245.000	Nordea Bank Abp*	1,50 %	30.09.2026	2.047.647	0,10
1.690.000	Nordea Bank Abp*	3,75 %	29.12.2049	1.339.236	0,07
540.000	Northern Oil & Gas Inc**	8,13 %	01.03.2028	547.312	0,03
635.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	4,75 %	30.04.2027	606.930	0,03
590.000	Northwest Fiber LLC/Northwest Fiber Finance Sub Inc**	6,00 %	15.02.2028	546.066	0,03
1.000.000	Northwestern Mutual Global Funding**	0,80 %	14.01.2026	925.349	0,05
1.150.000	Novelis Corp**	3,88 %	15.08.2031	1.015.087	0,05
515.000	NRG Energy Inc**	3,38 %	15.02.2029	455.437	0,02
1.570.000	NRG Energy Inc**	3,63 %	15.02.2031	1.350.803	0,07
29.000	NRG Energy Inc**	3,88 %	15.02.2032	24.860	0,00
555.000	NRG Energy Inc**	10,25 %	29.12.2049	578.355	0,03
1.995.000	NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA Inc**	5,00 %	15.01.2033	1.999.403	0,10
660.000	Olympus Water US Holding Corp**	4,25 %	01.10.2028	594.633	0,03
540.000	Olympus Water US Holding Corp**	9,75 %	15.11.2028	573.827	0,03
825.000	OneMain Finance Corp**	6,88 %	15.03.2025	835.795	0,04
565.000	OneMain Finance Corp**	7,13 %	15.03.2026	575.997	0,03
1.830.000	Oracle Corp*	3,95 %	25.03.2051	1.435.744	0,07
3.570.000	Oracle Corp*	4,00 %	15.11.2047	2.834.160	0,14

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
2.920.000	Oracle Corp*	5,55 %	06.02.2053	2.924.210	0,14
1.075.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63 %	24.04.2028	1.126.462	0,06
50.000	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC**	4,00 %	15.10.2027	46.781	0,00
715.000	Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Pactiv Evergreen Group Issuer Inc**	4,38 %	15.10.2028	669.165	0,03
505.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer**	5,88 %	01.10.2028	497.120	0,02
595.000	Performance Food Group Inc**	5,50 %	15.10.2027	586.910	0,03
460.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	454.360	0,02
725.000	Permian Resources Operating LLC**	7,00 %	15.01.2032	748.503	0,04
420.000	Pertamina Persero PT*	6,45 %	30.05.2044	460.880	0,02
762.400	Petroleos de Venezuela SA*	5,38 %	12.04.2027	85.008	0,00
4.488.565	Petroleos de Venezuela SA*	6,00 %	16.05.2024	516.086	0,03
2.302.978	Petroleos de Venezuela SA**	6,00 %	15.11.2026	267.721	0,01
810.000	Petroleos Mexicanos**	6,35 %	12.02.2048	514.984	0,03
1.935.000	Petroleos Mexicanos**	7,69 %	23.01.2050	1.378.561	0,07
550.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**	4,75 %	15.02.2028	518.938	0,03
585.000	PetSmart Inc/PetSmart Finance Corp**	7,75 %	15.02.2029	569.584	0,03
1.475.000	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd*	5,34 %	19.05.2063	1.490.381	0,07
1.140.000	Pilgrim's Pride Corp**	3,50 %	01.03.2032	965.255	0,05
490.000	Pilgrim's Pride Corp**	4,25 %	15.04.2031	443.186	0,02
280.000	Pilgrim's Pride Corp**	6,25 %	01.07.2033	288.449	0,01
410.000	Pilgrim's Pride Corp**	6,88 %	15.05.2034	443.142	0,02
3.783.000	PNC Financial Services Group Inc**	3,40 %	29.12.2049	3.035.572	0,15
685.000	PNC Financial Services Group Inc**	6,25 %	29.12.2049	640.247	0,03
1.655.000	PNC Financial Services Group Inc**	6,88 %	20.10.2034	1.837.976	0,09
600.000	PPL Capital Funding Inc*	8,27 %	30.03.2067	560.152	0,03
420.000	Presidio Holdings Inc**	4,88 %	01.02.2027	412.076	0,02
425.000	Presidio Holdings Inc**	8,25 %	01.02.2028	429.803	0,02
67.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,25 %	15.04.2024	66.627	0,00
355.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	5,75 %	15.04.2026	357.147	0,02
1.075.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc**	6,25 %	15.01.2028	1.069.570	0,05
3.000.000	Principal Life Global Funding II**	1,50 %	17.11.2026	2.732.139	0,14
390.000	Protective Life Global Funding**	1,30 %	20.09.2026	353.661	0,02
655.000	Prudential Financial Inc**	5,13 %	01.03.2052	617.171	0,03
725.000	Raptor Acquisition Corp/Raptor Co-Issuer LLC**	4,88 %	01.11.2026	691.718	0,03
805.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,25 %	15.04.2030	601.844	0,03
536.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp**	5,75 %	15.01.2029	417.155	0,02
295.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,50 %	15.02.2029	274.602	0,01
620.000	RHP Hotel Properties LP/RHP Finance Corp**	4,75 %	15.10.2027	599.308	0,03
240.000	Ritchie Bros Holdings Inc**	6,75 %	15.03.2028	247.397	0,01
360.000	Ritchie Bros Holdings Inc**	7,75 %	15.03.2031	384.250	0,02

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
625.000	RLJ Lodging Trust LP**	3,75 %	01.07.2026	592.659	0,03
365.000	RLJ Lodging Trust LP**	4,00 %	15.09.2029	328.373	0,02
430.000	Rockcliff Energy II LLC**	5,50 %	15.10.2029	406.975	0,02
1.420.000	Rogers Communications Inc**	3,80 %	15.03.2032	1.307.168	0,06
2.845.000	Royal Bank of Canada**	4,95 %	25.04.2025	2.847.737	0,14
865.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	31.08.2026	857.019	0,04
655.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	5,50 %	01.04.2028	647.064	0,03
245.000	Royal Caribbean Cruises Ltd**	8,25 %	15.01.2029	260.514	0,01
1.920.000	RTX Corp*	6,10 %	15.03.2034	2.084.454	0,10
1.355.000	SBA Tower Trust**	2,84 %	15.01.2025	1.308.999	0,07
675.000	Sealed Air Corp**	5,00 %	15.04.2029	653.467	0,03
525.000	SeaWorld Parks & Entertainment Inc**	5,25 %	15.08.2029	491.393	0,02
260.000	Sensata Technologies BV**	4,00 %	15.04.2029	241.911	0,01
495.000	Sensata Technologies BV**	5,88 %	01.09.2030	492.318	0,02
785.000	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp**	4,75 %	15.02.2028	738.877	0,04
1.015.000	Simon Property Group LP*	6,25 %	15.01.2034	1.104.925	0,05
460.000	Sirius XM Radio Inc**	4,00 %	15.07.2028	425.722	0,02
165.000	Six Flags Entertainment Corp**	5,50 %	15.04.2027	161.434	0,01
325.000	Six Flags Entertainment Corp**	7,25 %	15.05.2031	326.212	0,02
2.000.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB*	5,13 %	29.12.2049	1.924.178	0,10
590.000	Solaris Midstream Holdings LLC**	7,63 %	01.04.2026	598.675	0,03
3.475.000	Southern Co**	4,00 %	15.01.2051	3.310.660	0,16
575.000	SPX FLOW Inc**	8,75 %	01.04.2030	575.661	0,03
275.000	SRS Distribution Inc**	6,13 %	01.07.2029	261.040	0,01
835.000	Standard Chartered Plc*	4,30 %	29.12.2049	680.958	0,03
520.000	Standard Industries Inc**	3,38 %	15.01.2031	448.115	0,02
740.000	Standard Industries Inc**	4,38 %	15.07.2030	680.492	0,03
2.325.000	State Street Corp**	1,75 %	06.02.2026	2.235.013	0,11
1.580.000	State Street Corp**	2,90 %	30.03.2026	1.535.947	0,08
1.055.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc*	2,63 %	14.07.2026	999.776	0,05
985.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc*	3,01 %	19.10.2026	938.571	0,05
210.000	Summer BC Bidco B LLC**	5,50 %	31.10.2026	196.897	0,01
865.000	Summit Midstream Holdings LLC/Summit Midstream Finance Corp**	9,00 %	15.10.2026	859.018	0,04
495.000	Sunnova Energy Corp**	5,88 %	01.09.2026	421.809	0,02
105.000	Sunnova Energy Corp**	11,75 %	01.10.2028	95.646	0,00
1.555.000	Sysco Corp*	3,15 %	14.12.2051	1.115.267	0,06
2.073.000	Sysco Corp*	6,60 %	01.04.2050	2.436.246	0,12
630.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	5,50 %	15.01.2028	596.014	0,03
735.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	31.12.2030	684.305	0,03
340.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	6,00 %	01.09.2031	314.964	0,02

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
265.000	Tallgrass Energy Partners LP/Tallgrass Energy Finance Corp**	7,50 %	01.10.2025	266.602	0,01
635.000	Team Health Holdings Inc†	13,50 %	30.06.2028	622.300	0,03
445.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	01.10.2028	444.132	0,02
700.000	Tenet Healthcare Corp**	6,13 %	15.06.2030	708.636	0,04
310.000	Tenet Healthcare Corp**	6,75 %	15.05.2031	317.223	0,02
735.000	Terex Corp**	5,00 %	15.05.2029	693.550	0,03
4.665.000	T-Mobile USA Inc**	3,40 %	15.10.2052	3.401.664	0,17
1.360.000	T-Mobile USA Inc**	4,50 %	15.04.2050	1.202.898	0,06
1.915.000	Toronto-Dominion Bank**	0,75 %	06.01.2026	1.769.565	0,09
1.980.000	Toronto-Dominion Bank**	3,77 %	06.06.2025	1.949.126	0,10
505.000	TransDigm Inc*	4,63 %	15.01.2029	474.448	0,02
1.010.000	TransDigm Inc*	5,50 %	15.11.2027	990.368	0,05
305.000	TransDigm Inc**	6,25 %	15.03.2026	304.783	0,02
690.000	TransDigm Inc**	6,75 %	15.08.2028	706.789	0,04
375.000	TransDigm Inc*	7,50 %	15.03.2027	377.134	0,02
590.000	Trivium Packaging Finance BV*	5,50 %	15.08.2026	579.471	0,03
500.000	Trivium Packaging Finance BV*	8,50 %	15.08.2027	490.814	0,02
950.000	Tronox Inc**	4,63 %	15.03.2029	842.169	0,04
190.000	Truist Financial Corp**	5,10 %	29.12.2049	173.129	0,01
2.630.000	Truist Financial Corp**	5,87 %	08.06.2034	2.684.683	0,13
289.000	Truist Financial Corp*	8,75 %	29.12.2049	288.409	0,01
200.000	UBS Group AG*	4,38 %	29.12.2049	158.456	0,01
2.330.000	UBS Group AG*	4,70 %	05.08.2027	2.297.939	0,11
620.000	UBS Group AG**	4,88 %	29.12.2049	559.998	0,03
1.516.000	UBS Group AG*	6,88 %	29.12.2049	1.494.208	0,07
1.130.000	UBS Group AG*	9,25 %	29.12.2049	1.255.168	0,06
1.000.000	UBS Group AG REG S**	9,25 %	29.12.2049	1.081.277	0,05
246.000	UniCredit SpA**	8,00 %	29.12.2049	245.244	0,01
1.095.000	United Airlines Inc**	4,38 %	15.04.2026	1.067.833	0,05
610.000	United Rentals North America Inc*	3,75 %	15.01.2032	540.415	0,03
590.000	United Rentals North America Inc*	5,25 %	15.01.2030	581.602	0,03
285.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC**	10,50 %	15.02.2028	289.178	0,01
3.350.000	US Bancorp**	3,70 %	29.12.2049	2.638.207	0,13
255.000	US Foods Inc**	6,88 %	15.09.2028	262.806	0,01
300.000	US Foods Inc**	7,25 %	15.01.2032	313.189	0,02
240.000	Valaris Ltd**	8,38 %	30.04.2030	246.095	0,01
395.000	Venture Global LNG Inc**	8,38 %	01.06.2031	395.390	0,02
385.000	Venture Global LNG Inc**	9,50 %	01.02.2029	407.635	0,02
245.000	Venture Global LNG Inc**	9,88 %	01.02.2032	255.355	0,01
2.775.000	Verizon Communications Inc*	2,99 %	30.10.2056	1.844.355	0,09

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 26,53 % (31. Dezember 2022: 48,20 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
690.000	Virgin Media Secured Finance Plc*	5,50 %	15.05.2029	667.483	0,03
665.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	6,38 %	01.02.2030	464.956	0,02
690.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	7,88 %	01.05.2027	594.267	0,03
250.000	VistaJet Malta Finance Plc/Vista Management Holding Inc**	9,50 %	01.06.2028	211.884	0,01
360.000	Vistra Corp**	7,00 %	29.12.2049	355.093	0,02
720.000	Vistra Operations Co LLC**	4,38 %	01.05.2029	672.926	0,03
170.000	Vistra Operations Co LLC**	5,50 %	01.09.2026	167.945	0,01
430.000	Vistra Operations Co LLC**	7,75 %	15.10.2031	446.916	0,02
4.540.000	Vodafone Group Plc**	4,88 %	19.06.2049	4.120.227	0,20
193.000	Volcan Compania Minera SAA*	4,38 %	11.02.2026	120.116	0,01
4.120.000	Warnermedia Holdings Inc**	5,14 %	15.03.2052	3.538.856	0,18
2.505.000	Wells Fargo & Co**	6,49 %	23.10.2034	2.726.607	0,14
2.565.000	Westpac Banking Corp**	3,02 %	18.11.2036	2.087.831	0,10
2.965.000	Westpac Banking Corp**	5,51 %	17.11.2025	3.014.162	0,15
425.000	White Cap Parent LLC**	8,25 %	15.03.2026	423.582	0,02
475.000	Windsor Holdings III LLC**	8,50 %	15.06.2030	496.982	0,02
430.000	WR Grace Holdings LLC**	5,63 %	15.08.2029	378.876	0,02
795.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc**	4,38 %	15.08.2028	743.941	0,04
660.000	Wynn Macau Ltd*	5,50 %	15.01.2026	644.740	0,03
240.000	XHR LP**	4,88 %	01.06.2029	221.191	0,01
635.000	XHR LP**	6,38 %	15.08.2025	633.955	0,03
1.240.000	Yum! Brands Inc*	5,38 %	01.04.2032	1.219.643	0,06
1.075.000	ZF North America Capital Inc**	6,88 %	14.04.2028	1.114.661	0,06
375.000	Ziff Davis Inc**	4,63 %	15.10.2030	344.454	0,02
	US-Dollar insgesamt			**432.669.604**	**21,42**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**535.844.310**	**26,53**
	Staatsanleihen 8,70 % (31. Dezember 2022: 18,40 %)				
	Kolumbianischer Peso				
911.400.000	Colombian TES*	6,00 %	28.04.2028	207.688	0,01
5.168.900.000	Colombian TES*	7,00 %	30.06.2032	1.118.972	0,06
3.618.000.000	Colombian TES*	7,25 %	18.10.2034	769.456	0,04
341.300.000	Colombian TES*	13,25 %	09.02.2033	104.639	0,00
	Kolumbianischer Peso insgesamt			**2.200.755**	**0,11**
	Ungarischer Forint				
995.190.000	Hungary Government Bond*	3,25 %	22.10.2031	2.445.886	0,12
58.290.000	Hungary Government Bond*	6,75 %	22.10.2028	174.938	0,01
	Ungarischer Forint insgesamt			**2.620.824**	**0,13**

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 8,70 % (31. Dezember 2022: 18,40 %) (Fortsetzung)				
	Indonesische Rupiah				
1.848.000.000	Indonesia Treasury Bond*	6,13 %	15.05.2028	118.565	0,01
12.889.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.09.2030	855.695	0,04
11.228.000.000	Indonesia Treasury Bond*	7,00 %	15.02.2033	756.371	0,04
28.842.000.000	Indonesia Treasury Bond*	8,25 %	15.05.2029	2.020.120	0,10
	Indonesische Rupiah insgesamt			**3.750.751**	**0,19**
	Mexikanischer Peso				
84.500.000	Mexican Bonos*	7,50 %	26.05.2033	4.555.524	0,23
27.490.000	Mexican Bonos*	7,75 %	29.05.2031	1.515.071	0,07
15.230.600	Mexican Bonos*	8,50 %	31.05.2029	880.657	0,04
	Mexikanischer Peso insgesamt			**6.951.252**	**0,34**
	Peruanischer Sol				
11.154.000	Peru Government Bond*	6,15 %	12.08.2032	2.943.542	0,14
4.237.000	Peruvian Government International Bond**	6,90 %	12.08.2037	1.154.779	0,06
	Peruanischer Sol insgesamt			**4.098.321**	**0,20**
	Polnischer Zloty				
7.068.000	Republic of Poland Government Bond*	6,00 %	25.10.2033	1.907.558	0,09
3.271.000	Republic of Poland Government Bond*	7,50 %	25.07.2028	916.005	0,05
	Polnischer Zloty insgesamt			**2.823.563**	**0,14**
	Rumänischer neuer Leu				
6.455.000	Romania Government Bond**	4,85 %	25.07.2029	1.345.988	0,07
10.790.000	Romania Government Bond*	8,25 %	29.09.2032	2.710.779	0,13
	Rumänischer neuer Leu insgesamt			**4.056.767**	**0,20**
	Südafrikanischer Rand				
24.429.108	Republic of South Africa Government Bond*	8,00 %	31.01.2030	1.231.407	0,06
15.379.799	Republic of South Africa Government Bond*	8,25 %	31.03.2032	736.674	0,04
4.946.939	Republic of South Africa Government Bond*	8,50 %	31.01.2037	211.958	0,01
	Südafrikanischer Rand insgesamt			**2.180.039**	**0,11**
	US-Dollar				
585.000	Angolan Government International Bond*	8,00 %	26.11.2029	521.230	0,03
1.175.000	Angolan Government International Bond*	9,38 %	08.05.2048	980.864	0,05
750.000	Brazilian Government International Bond*	6,00 %	20.10.2033	751.646	0,04
485.000	Colombia Government International Bond*	3,00 %	30.01.2030	410.514	0,02
400.000	Colombia Government International Bond*	7,50 %	02.02.2034	423.211	0,02
1.925.000	Dominican Republic International Bond*	6,85 %	27.01.2045	1.925.000	0,10

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 8,70 % (31. Dezember 2022: 18,40 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
645.000	Ecuador Government International Bond*	3,50 %	31.07.2035	232.444	0,01
420.000	Ecuador Government International Bond*	6,00 %	31.07.2030	196.270	0,01
345.000	Egypt Government International Bond*	5,88 %	16.02.2031	226.929	0,01
1.310.000	Egypt Government International Bond*	8,50 %	31.01.2047	818.671	0,04
200.000	El Salvador Government International Bond*	9,50 %	15.07.2052	167.510	0,01
1.815.000	Indonesia Government International Bond*	4,63 %	15.04.2043	1.777.269	0,09
1.700.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,13 %	15.06.2033	1.568.522	0,08
1.895.000	Mexico Government International Bond*	3,50 %	12.02.2034	1.607.949	0,08
1.890.000	Mexico Government International Bond*	4,40 %	12.02.2052	1.501.679	0,07
485.000	Mongolia Government International Bond*	5,13 %	07.04.2026	471.618	0,02
1.195.000	Oman Government International Bond*	7,00 %	25.01.2051	1.293.038	0,06
825.000	Panama Government International Bond*	2,25 %	29.09.2032	603.568	0,03
1.100.000	Panama Government International Bond*	3,30 %	19.01.2033	871.633	0,04
815.000	Paraguay Government International Bond*	4,95 %	28.04.2031	797.681	0,04
635.000	Qatar Government International Bond*	4,40 %	16.04.2050	586.581	0,03
785.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,65 %	27.09.2047	629.923	0,03
485.000	Republic of South Africa Government International Bond*	5,75 %	30.09.2049	388.776	0,02
1.422.000	Romanian Government International Bond*	3,00 %	14.02.2031	1.213.734	0,06
580.000	Romanian Government International Bond*	3,63 %	27.03.2032	503.150	0,02
630.000	Romanian Government International Bond*	4,00 %	14.02.2051	458.513	0,02
1.184.000	Romanian Government International Bond 144A*	4,00 %	14.02.2051	861.481	0,04
725.000	Saudi Government International Bond*	3,25 %	17.11.2051	516.820	0,03
580.000	Saudi Government International Bond*	3,75 %	21.01.2055	442.908	0,02
1.800.000	Ukraine Government International Bond*	7,25 %	15.03.2035	437.708	0,02
19.825.000	United States Treasury Note/Bond*	0,88 %	30.06.2026	18.335.415	0,91
18.530.000	United States Treasury Note/Bond*	1,25 %	31.03.2028	16.619.456	0,82
20.000.000	United States Treasury Note/Bond*	1,25 %	15.08.2031	16.555.859	0,82
28.860.000	United States Treasury Note/Bond*	1,63 %	15.05.2031	24.763.233	1,23
8.525.000	United States Treasury Note/Bond*	2,00 %	15.02.2050	5.611.848	0,28
7.240.000	United States Treasury Note/Bond*	2,38 %	15.05.2051	5.168.681	0,26
5.445.000	United States Treasury Note/Bond*	3,00 %	15.11.2044	4.508.715	0,22
14.580.000	United States Treasury Note/Bond*	3,38 %	15.05.2033	13.996.800	0,69
1.955.000	United States Treasury Note/Bond*	3,38 %	15.05.2044	1.724.447	0,09
6.355.000	United States Treasury Note/Bond*	3,63 %	15.05.2053	5.876.886	0,29
1.845.000	United States Treasury Note/Bond*	3,75 %	15.11.2043	1.725.003	0,09
7.405.000	United States Treasury Note/Bond*	4,50 %	15.05.2038	7.872.730	0,39
545.000	Uruguay Government International Bond*	5,10 %	18.06.2050	548.591	0,03
3.136.300	Venezuela Government International Bond*	8,25 %	13.10.2024	493.104	0,02
	US-Dollar insgesamt			**146.987.608**	**7,28**
	Staatsanleihen insgesamt			**175.669.880**	**8,70**

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %)				
	US-Dollar				
1.950.239	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.08.2051	1.659.993	0,08
4.687.144	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.09.2051	3.991.989	0,20
2.777.956	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.10.2051	2.369.019	0,12
4.058.174	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.11.2051	3.458.324	0,17
3.325.391	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.12.2051	2.829.430	0,14
615.364	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.01.2052	526.267	0,03
3.095.752	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.02.2052	2.636.285	0,13
655.138	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.03.2052	558.483	0,03
4.175.014	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.04.2052	3.555.234	0,18
2.355.557	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.05.2052	2.013.763	0,10
1.418.001	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.06.2052	1.207.235	0,06
45.015.000	Fannie Mae Pool	2,50 %	01.01.2054	38.301.435	1,90
2.056.255	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.06.2050	1.831.115	0,09
1.037.524	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.04.2051	919.215	0,05
1.473.125	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.05.2051	1.314.695	0,07
2.182.412	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.08.2051	1.931.787	0,10
2.353.223	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.11.2051	2.097.625	0,10
219.903	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.12.2051	194.587	0,01
923.225	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.01.2052	817.483	0,04
1.185.521	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.02.2052	1.049.705	0,05
3.762.124	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.03.2052	3.329.316	0,16
1.205.309	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.04.2052	1.067.195	0,05
1.726.867	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.05.2052	1.528.046	0,08
1.113.878	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.06.2052	986.125	0,05
610.897	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.08.2052	540.564	0,03
2.096.855	Fannie Mae Pool	3,00 %	01.03.2053	1.855.159	0,09
1.112.973	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.05.2051	1.029.745	0,05
800.929	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.12.2051	734.926	0,04
700.781	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.02.2052	646.456	0,03
2.475.189	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.03.2052	2.280.353	0,11
3.821.555	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.04.2052	3.508.033	0,17
2.690.123	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.05.2052	2.469.325	0,12
4.467.795	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.06.2052	4.101.271	0,20
4.881.736	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.07.2052	4.481.250	0,22
2.825.530	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.05.2053	2.593.507	0,13
15.600.000	Fannie Mae Pool	3,50 %	01.01.2054	14.313.000	0,71
1.271.706	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.02.2052	1.203.916	0,06
1.260.592	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.05.2052	1.193.524	0,06
4.615.225	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.06.2052	4.367.292	0,22
8.805.998	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.07.2052	8.338.306	0,41

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
5.792.796	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.08.2052	5.481.450	0,27
3.377.005	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.09.2052	3.195.498	0,16
3.746.905	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.10.2052	3.545.423	0,18
5.971.211	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.12.2052	5.650.120	0,28
3.961.371	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.02.2053	3.747.847	0,19
35.210.000	Fannie Mae Pool	4,00 %	01.01.2054	33.305.084	1,65
1.074.846	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.06.2052	1.042.652	0,05
4.025.843	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.07.2052	3.905.261	0,19
5.590.063	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.08.2052	5.422.629	0,27
5.460.468	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.09.2052	5.296.916	0,26
1.554.154	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.10.2052	1.507.604	0,07
5.433.898	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.11.2052	5.271.142	0,26
3.950.418	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.01.2053	3.832.096	0,19
31.475.000	Fannie Mae Pool	4,50 %	01.01.2054	30.513.537	1,51
1.926.153	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.08.2052	1.908.812	0,09
5.748.149	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.09.2052	5.696.367	0,28
3.139.327	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.10.2052	3.111.047	0,15
625.487	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.11.2052	619.277	0,03
1.024.759	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.12.2052	1.015.059	0,05
3.421.996	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.01.2053	3.390.747	0,17
2.778.550	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.02.2053	2.749.929	0,14
3.926.315	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.03.2053	3.888.637	0,19
4.971.875	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.04.2053	4.920.662	0,24
1.955.870	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.05.2053	1.935.723	0,10
4.158.181	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.06.2053	4.116.292	0,20
1.759.537	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.07.2053	1.741.138	0,09
1.425.036	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.09.2053	1.410.134	0,07
13.560.000	Fannie Mae Pool	5,00 %	01.01.2054	13.416.984	0,66
1.559.732	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.12.2052	1.569.739	0,08
4.023.923	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.01.2053	4.042.984	0,20
1.042.038	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.02.2053	1.047.012	0,05
3.259.114	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.03.2053	3.275.885	0,16
3.503.423	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.04.2053	3.524.185	0,17
5.125.969	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.05.2053	5.148.694	0,25
1.857.798	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.06.2053	1.867.896	0,09
3.741.411	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.07.2053	3.758.762	0,19
4.285.412	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.08.2053	4.303.741	0,21
822.803	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.09.2053	826.323	0,04
2.183.038	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.10.2053	2.192.572	0,11
82.375.000	Fannie Mae Pool	5,50 %	01.01.2054	82.735.391	4,10

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
2.888.943	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.01.2053	2.936.473	0,15
3.586.028	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.02.2053	3.646.336	0,18
1.339.801	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.04.2053	1.363.679	0,07
3.142.034	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.06.2053	3.191.535	0,16
2.152.272	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.07.2053	2.185.844	0,11
2.412.015	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.08.2053	2.449.638	0,12
2.673.155	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.10.2053	2.722.692	0,13
30.385.000	Fannie Mae Pool	6,00 %	01.01.2054	30.855.018	1,53
736.767	Fannie Mae Pool	6,50 %	01.11.2053	755.265	0,04
2.808.838	Fannie Mae Pool (BU8723)	3,50 %	01.06.2052	2.578.398	0,13
1.347.169	Fannie Mae Pool (BV2623)	4,50 %	01.07.2052	1.306.819	0,06
1.422.551	Fannie Mae Pool (BV2634)	4,00 %	01.07.2052	1.345.689	0,07
1.141.937	Fannie Mae Pool (BV7928)	4,50 %	01.08.2052	1.107.734	0,05
1.667.254	Fannie Mae Pool (BV7959)	5,00 %	01.08.2052	1.652.244	0,08
691.647	Fannie Mae Pool (BV8055)	4,50 %	01.09.2052	670.930	0,03
2.522.686	Fannie Mae Pool (BW1192)	4,50 %	01.09.2052	2.447.126	0,12
4.795.845	Fannie Mae Pool (BW1502)	4,50 %	01.07.2052	4.652.200	0,23
2.767.898	Fannie Mae Pool (BW9903)	4,50 %	01.10.2052	2.684.994	0,13
1.628.979	Fannie Mae Pool (BX3198)	4,00 %	01.12.2052	1.541.343	0,08
2.304.577	Fannie Mae Pool (BX5065)	5,50 %	01.01.2053	2.315.627	0,11
2.014.519	Fannie Mae Pool (BX7768)	5,00 %	01.03.2053	1.993.919	0,10
2.067.577	Fannie Mae Pool (BX8626)	5,50 %	01.04.2053	2.078.816	0,10
571.475	Fannie Mae Pool (CB2759)	3,00 %	01.02.2052	505.913	0,03
2.454.751	Fannie Mae Pool (CB3158)	2,50 %	01.03.2052	2.101.813	0,10
2.238.031	Fannie Mae Pool (CB3600)	3,50 %	01.05.2052	2.061.769	0,10
1.033.754	Fannie Mae Pool (CB3770)	3,50 %	01.06.2052	948.966	0,05
843.548	Fannie Mae Pool (CB3780)	3,50 %	01.05.2052	774.341	0,04
2.076.876	Fannie Mae Pool (CB3897)	3,50 %	01.06.2052	1.906.441	0,09
1.371.115	Fannie Mae Pool (CB3899)	3,50 %	01.06.2052	1.263.118	0,06
3.590.361	Fannie Mae Pool (CB3914)	4,00 %	01.06.2052	3.397.539	0,17
274.408	Fannie Mae Pool (CB4386)	4,50 %	01.08.2052	266.189	0,01
472.826	Fannie Mae Pool (CB4612)	4,50 %	01.09.2052	458.664	0,02
3.609.533	Fannie Mae Pool (CB4613)	4,50 %	01.09.2052	3.501.420	0,17
2.234.441	Fannie Mae Pool (CB4861)	5,00 %	01.10.2052	2.211.546	0,11
754.154	Fannie Mae Pool (CB5592)	5,50 %	01.02.2053	757.497	0,04
1.830.780	Fannie Mae Pool (CB5636)	5,00 %	01.02.2053	1.816.558	0,09
1.508.242	Fannie Mae Pool (CB5906)	5,50 %	01.03.2053	1.516.887	0,08
4.587.926	Fannie Mae Pool (CB6031)	5,00 %	01.04.2053	4.541.732	0,22
2.368.995	Fannie Mae Pool (FS1172)	3,00 %	01.11.2051	2.098.895	0,10
3.410.166	Fannie Mae Pool (FS1632)	2,50 %	01.08.2051	2.910.590	0,14

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
319.484	Fannie Mae Pool (FS1790)	4,00 %	01.05.2052	302.331	0,02
1.402.097	Fannie Mae Pool (FS1866)	3,50 %	01.05.2052	1.289.901	0,06
4.066.199	Fannie Mae Pool (FS1921)	2,50 %	01.02.2052	3.465.246	0,17
3.262.455	Fannie Mae Pool (FS2043)	2,50 %	01.04.2052	2.790.568	0,14
2.105.488	Fannie Mae Pool (FS2707)	3,50 %	01.04.2052	1.932.809	0,10
3.342.673	Fannie Mae Pool (FS3205)	2,50 %	01.04.2052	2.858.901	0,14
4.702.604	Fannie Mae Pool (FS3213)	3,50 %	01.07.2052	4.316.804	0,21
4.850.777	Fannie Mae Pool (FS3457)	4,50 %	01.11.2052	4.705.487	0,23
3.813.601	Fannie Mae Pool (FS3539)	3,50 %	01.07.2052	3.500.648	0,17
1.792.929	Fannie Mae Pool (FS3642)	5,00 %	01.11.2052	1.776.233	0,09
1.142.434	Fannie Mae Pool (FS3662)	5,00 %	01.01.2053	1.136.218	0,06
1.199.859	Fannie Mae Pool (FS3747)	5,50 %	01.12.2052	1.207.830	0,06
3.563.062	Fannie Mae Pool (FS3881)	5,50 %	01.02.2053	3.584.636	0,18
1.923.213	Fannie Mae Pool (FS4190)	5,00 %	01.04.2053	1.905.413	0,09
2.989.690	Fannie Mae Pool (FS4357)	5,50 %	01.04.2053	3.009.178	0,15
2.524.827	Fannie Mae Pool (FS4933)	6,00 %	01.06.2053	2.568.892	0,13
2.186.842	Fannie Mae Pool (FS4967)	4,00 %	01.10.2052	2.069.252	0,10
3.513.176	Fannie Mae Pool (FS5235)	5,50 %	01.07.2053	3.529.401	0,17
1.542.990	Fannie Mae Pool (FS5673)	4,00 %	01.02.2053	1.460.141	0,07
447.841	Fannie Mae Pool (MA4466)	2,50 %	01.11.2051	381.423	0,02
889.986	Fannie Mae Pool (MA4579)	3,00 %	01.04.2052	787.518	0,04
1.380.018	Fannie Mae Pool (MA4600)	3,50 %	01.05.2052	1.266.804	0,06
672.938	Fannie Mae Pool (MA4626)	4,00 %	01.06.2052	636.805	0,03
3.491.390	Fannie Mae Pool (MA5038)	5,00 %	01.06.2053	3.455.426	0,17
336.437	Fannie Mae Pool (MA5166)	6,00 %	01.10.2053	341.685	0,02
1.780.250	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.05.2051	1.517.225	0,08
1.757.967	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.09.2051	1.497.517	0,07
923.849	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.10.2051	787.142	0,04
878.889	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.11.2051	748.453	0,04
1.258.663	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.12.2051	1.071.794	0,05
2.135.542	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.01.2052	1.818.483	0,09
2.779.340	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.02.2052	2.366.621	0,12
3.687.195	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.03.2052	3.139.557	0,16
5.186.485	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.04.2052	4.422.118	0,22
115.442	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.05.2052	98.289	0,00
539.308	Freddie Mac Pool	2,50 %	01.07.2052	459.278	0,02
1.694.323	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.07.2051	1.499.191	0,07
357.557	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.11.2051	317.492	0,02
2.558.548	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.12.2051	2.265.773	0,11
714.019	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.01.2052	637.249	0,03

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
472.599	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.03.2052	418.720	0,02
2.276.806	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.04.2052	2.019.311	0,10
2.767.262	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.05.2052	2.449.234	0,12
521.157	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.06.2052	462.221	0,02
236.728	Freddie Mac Pool	3,00 %	01.08.2052	209.553	0,01
3.782.369	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.04.2052	3.470.698	0,17
693.248	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.06.2052	636.310	0,03
5.098.417	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.09.2052	4.677.555	0,23
2.029.283	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.11.2052	1.862.449	0,09
2.126.451	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.12.2052	1.951.173	0,10
891.984	Freddie Mac Pool	3,50 %	01.05.2053	818.725	0,04
2.030.858	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.04.2052	1.922.744	0,10
1.526.733	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.05.2052	1.444.708	0,07
1.463.019	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.06.2052	1.384.453	0,07
3.332.106	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.08.2052	3.153.078	0,16
5.804.355	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.09.2052	5.492.193	0,27
3.936.352	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.11.2052	3.723.253	0,18
5.457.754	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.01.2053	5.163.666	0,26
1.266.321	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.04.2053	1.197.953	0,06
4.250.970	Freddie Mac Pool	4,00 %	01.06.2053	4.020.840	0,20
1.402.728	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.06.2052	1.363.649	0,07
1.169.165	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.07.2052	1.134.146	0,06
3.964.976	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.08.2052	3.846.217	0,19
1.495.006	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.09.2052	1.450.227	0,07
4.170.256	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.10.2052	4.045.348	0,20
2.685.830	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.11.2052	2.605.384	0,13
398.395	Freddie Mac Pool	4,50 %	01.05.2053	386.462	0,02
6.700.245	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.10.2052	6.631.227	0,33
4.056.323	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.11.2052	4.019.783	0,20
1.449.946	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.12.2052	1.435.547	0,07
6.252.352	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.01.2053	6.190.260	0,31
4.243.539	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.02.2053	4.199.828	0,21
644.923	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.03.2053	638.694	0,03
4.902.039	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.04.2053	4.851.545	0,24
4.304.221	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.05.2053	4.259.885	0,21
2.576.429	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.06.2053	2.549.487	0,13
1.134.386	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.07.2053	1.122.523	0,06
2.408.611	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.08.2053	2.383.425	0,12
475.000	Freddie Mac Pool	5,00 %	01.01.2054	470.033	0,02
2.385.045	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.11.2052	2.402.477	0,12

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
4.518.769	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.04.2053	4.539.583	0,22
4.592.111	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.05.2053	4.612.468	0,23
4.836.718	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.06.2053	4.858.160	0,24
2.180.643	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.07.2053	2.189.970	0,11
3.539.700	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.08.2053	3.564.881	0,18
2.542.701	Freddie Mac Pool	5,50 %	01.09.2053	2.553.576	0,13
1.453.352	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.01.2053	1.476.687	0,07
3.655.288	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.05.2053	3.716.828	0,18
3.547.631	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.06.2053	3.608.720	0,18
1.081.757	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.07.2053	1.098.630	0,05
3.835.209	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.08.2053	3.903.176	0,19
1.835.611	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.09.2053	1.864.243	0,09
3.456.513	Freddie Mac Pool	6,00 %	01.10.2053	3.510.428	0,17
1.748.986	Freddie Mac Pool	6,50 %	01.07.2053	1.792.899	0,09
317.637	Freddie Mac Pool (QC6452)	2,50 %	01.09.2051	270.491	0,01
1.222.441	Freddie Mac Pool (QE2363)	3,50 %	01.05.2052	1.121.287	0,06
2.138.785	Freddie Mac Pool (QE2482)	3,50 %	01.05.2052	1.962.570	0,10
2.794.127	Freddie Mac Pool (QE7028)	4,50 %	01.08.2052	2.710.437	0,13
787.607	Freddie Mac Pool (QE8253)	4,50 %	01.08.2052	764.017	0,04
3.577.777	Freddie Mac Pool (QF6256)	5,00 %	01.01.2053	3.544.602	0,18
595.009	Freddie Mac Pool (QF7085)	5,50 %	01.02.2053	598.274	0,03
835.660	Freddie Mac Pool (RA5546)	3,00 %	01.07.2051	740.801	0,04
2.238.264	Freddie Mac Pool (RA7642)	4,50 %	01.08.2052	2.171.224	0,11
1.027.085	Freddie Mac Pool (RA7784)	4,50 %	01.08.2052	996.322	0,05
2.419.325	Freddie Mac Pool (RA7921)	4,00 %	01.09.2052	2.289.084	0,11
2.026.099	Freddie Mac Pool (RA8247)	5,00 %	01.11.2052	2.007.586	0,10
4.038.183	Freddie Mac Pool (SD1011)	2,50 %	01.04.2052	3.438.616	0,17
1.534.196	Freddie Mac Pool (SD1060)	4,00 %	01.07.2052	1.452.554	0,07
3.749.209	Freddie Mac Pool (SD1724)	4,00 %	01.09.2052	3.553.258	0,18
1.172.655	Freddie Mac Pool (SD1913)	5,00 %	01.11.2052	1.163.546	0,06
292.300	Freddie Mac Pool (SD2190)	4,50 %	01.10.2052	283.545	0,01
1.013.352	Freddie Mac Pool (SD2334)	5,00 %	01.02.2053	1.003.264	0,05
1.005.020	Freddie Mac Pool (SD2611)	4,00 %	01.11.2052	951.029	0,05
2.149.713	Freddie Mac Pool (SD2642)	5,50 %	01.04.2053	2.162.216	0,11
648.118	Freddie Mac Pool (SD2862)	6,00 %	01.05.2053	658.697	0,03
1.931.789	Freddie Mac Pool (SD3010)	5,50 %	01.06.2053	1.945.485	0,10
801.715	Freddie Mac Pool (SD3136)	5,50 %	01.06.2053	807.284	0,04
1.277.559	Freddie Mac Pool (SD3209)	2,50 %	01.04.2052	1.088.282	0,05
2.018.689	Freddie Mac Pool (SD3218)	5,00 %	01.05.2053	1.997.895	0,10
710.917	Freddie Mac Pool (SD3371)	5,50 %	01.05.2053	715.889	0,04

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Mortgage-Backed Securities 45,47 % (31. Dezember 2022: 26,22 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.621.786	Freddie Mac Pool (SD3392)	5,50 %	01.07.2053	1.631.528	0,08
2.298.030	Freddie Mac Pool (SD8205)	2,50 %	01.04.2052	1.956.651	0,10
1.127.705	Freddie Mac Pool (SD8206)	3,00 %	01.04.2052	998.250	0,05
2.342.945	Freddie Mac Pool (SD8213)	3,00 %	01.05.2052	2.072.898	0,10
4.958.967	Freddie Mac Pool (SD8221)	3,50 %	01.06.2052	4.550.333	0,23
1.119.103	Freddie Mac Pool (SD8231)	4,50 %	01.07.2052	1.085.584	0,05
4.917.023	Freddie Mac Pool (SD8237)	4,00 %	01.08.2052	4.652.713	0,23
7.043.119	Freddie Mac Pool (SD8238)	4,50 %	01.08.2052	6.832.164	0,34
4.929.259	Freddie Mac Pool (SD8257)	4,50 %	01.10.2052	4.781.618	0,24
2.535.980	Freddie Mac Pool (SD8300)	5,50 %	01.02.2053	2.549.838	0,13
3.771.105	Freddie Mac Pool (SD8350)	6,00 %	01.08.2053	3.829.927	0,19
21.640.000	Ginnie Mae	5,00 %	01.01.2054	21.491.252	1,06
8.775.000	Ginnie Mae	5,50 %	01.01.2054	8.839.463	0,44
29.315.000	Ginnie Mae	6,00 %	01.01.2054	29.810.836	1,48
1.441.669	Ginnie Mae II Pool	5,00 %	20.11.2052	1.432.068	0,07
1.107.167	Ginnie Mae II Pool	5,00 %	20.02.2053	1.100.601	0,05
1.453.815	Ginnie Mae II Pool	5,00 %	20.03.2053	1.444.819	0,07
1.015.786	Ginnie Mae II Pool	5,00 %	20.04.2053	1.009.342	0,05
1.943.343	Ginnie Mae II Pool	5,00 %	20.05.2053	1.929.517	0,10
2.226.034	Ginnie Mae II Pool	5,00 %	20.07.2053	2.210.196	0,11
1.140.499	Ginnie Mae II Pool	5,00 %	20.08.2053	1.132.384	0,06
2.117.934	Ginnie Mae II Pool	5,50 %	20.06.2053	2.134.019	0,11
4.397.881	Ginnie Mae II Pool	5,50 %	20.07.2053	4.431.282	0,22
1.288.392	Ginnie Mae II Pool	5,50 %	20.08.2053	1.298.176	0,06
1.191.866	Ginnie Mae II Pool	6,00 %	20.12.2052	1.212.638	0,06
740.956	Ginnie Mae II Pool	6,00 %	20.03.2053	753.869	0,04
3.876.536	Ginnie Mae II Pool	6,00 %	20.06.2053	3.943.489	0,20
6.043.796	Ginnie Mae II Pool	6,00 %	20.07.2053	6.148.180	0,30
4.968.670	Ginnie Mae II Pool	6,00 %	20.08.2053	5.054.485	0,25
3.180.755	Ginnie Mae II Pool	6,00 %	20.10.2053	3.235.690	0,16
2.380.000	Ginnie Mae II Pool	6,00 %	20.12.2053	2.421.106	0,12
	Mortgage-Backed Securities insgesamt **			**918.338.562**	**45,47**
	Kommunalanleihen 0,64 % (31. Dezember 2022: 1,57 %)				
	US-Dollar				
565.000	Bay Area Toll Authority	7,04 %	01.04.2050	716.990	0,04
845.000	California State University	2,98 %	01.11.2051	603.078	0,03
875.000	Central Texas Turnpike System	3,03 %	15.08.2041	658.651	0,03
265.000	City of Atlantic City NJ	4,29 %	01.09.2026	260.431	0,01
845.000	Commonwealth Financing Authority	3,53 %	01.06.2042	708.283	0,04

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Kommunalanleihen 0,64 % (31. Dezember 2022: 1,57 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
845.000	County of Clark NV	3,23 %	01.07.2044	648.130	0,03
705.000	Dallas Area Rapid Transit	2,82 %	01.12.2042	540.310	0,03
795.000	Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency	3,92 %	15.01.2053	638.381	0,03
845.000	Grand Parkway Transportation Corp	3,24 %	01.10.2052	636.803	0,03
845.000	Highland Local School District/Medina County	3,19 %	01.12.2049	640.675	0,03
845.000	JobsOhio Beverage System	2,83 %	01.01.2038	690.169	0,03
460.000	Los Angeles Community College District	6,75 %	01.08.2049	575.015	0,03
400.000	Massachusetts Educational Financing Authority	4,08 %	01.07.2027	392.191	0,02
725.000	Michigan Finance Authority	3,38 %	01.12.2040	594.451	0,03
200.000	New Jersey Housing & Mortgage Finance Agency	3,80 %	01.10.2032	192.642	0,01
1.125.000	New York State Dormitory Authority	2,69 %	01.07.2040	854.703	0,04
840.000	Ohio Turnpike & Infrastructure Commission	3,22 %	15.02.2048	633.790	0,03
845.000	Ohio University	2,91 %	01.12.2043	632.266	0,03
705.000	Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue	3,01 %	15.05.2050	500.692	0,03
565.000	State of California	7,63 %	01.03.2040	710.466	0,04
530.000	Texas Private Activity Bond Surface Transportation Corp	3,92 %	31.12.2049	430.866	0,02
845.000	Utah Transit Authority	2,77 %	15.12.2038	659.840	0,03
	Kommunalanleihen insgesamt †			**12.918.823**	**0,64**
	Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)				
	US-Dollar				
95.846	GTT Communications Inc	12,46 %	30.12.2027	83.446	0,00
78.190	GTT Communications Inc	14,45 %	30.06.2028	50.563	0,00
361.611	Nautilus Power LLC	10,86 %	16.11.2026	295.810	0,02
	Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †			**429.819**	**0,02**

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Investmentfonds 3,01 % (31. Dezember 2022: 4,40 %)		
	Britisches Pfund		
163.871	NB Global Monthly Income Fund Ltd	145.814	0,01
	Britisches Pfund insgesamt	**145.814**	**0,01**
	US-Dollar		
1.208.113	Neuberger Berman China Bond Fund	11.936.155	0,59
760.691	Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund	9.158.724	0,45
486.855	Neuberger Berman European High Yield Fund	6.382.668	0,32
459.982	Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund	5.570.377	0,28
654.438	Neuberger Berman Global SDG Engagement Fund	8.952.716	0,44

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Investmentfonds 3.01 % (31. Dezember 2022: 4,40 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
2.000.000	Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund	18.620.000	0,92
	US-Dollar insgesamt	**60.620.640**	**3,00**
	Investmentfonds insgesamt [µ]	**60.766.454**	**3,01**
	Anlagen insgesamt	**2.136.969.841**	**105,81**

Devisenterminkontrakte 1,01 % (31. Dezember 2022: 2,24 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
12.125.286 BRL	2.373.472 US$	25.01.2024	Citibank NA	1	119.205	0,01
154.099 BRL	31.069 US$	03.04.2024	Citibank NA	1	388	0,00
15.919.680 BRL	3.220.000 US$	09.01.2024	Goldman Sachs International	1	55.192	0,00
2.283.491 BRL	466.918 US$	25.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.515	0,00
2.779.597 BRL	559.545 US$	03.04.2024	Morgan Stanley	1	7.862	0,00
1.283.559 BRL	254.847 US$	25.01.2024	Standard Chartered Bank	1	9.023	0,00
353.680.999 CLP	399.481 US$	20.03.2024	Goldman Sachs International	1	3.897	0,00
1.062.314.206 COP	260.620 US$	20.03.2024	Goldman Sachs International	1	9.363	0,00
862.968 €	943.198 US$	04.01.2024	Barclays Bank Plc	2	10.117	0,00
1.060.596 €	26.006.283 CZK	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	14.041	0,00
309.741 €	339.704 US$	04.01.2024	Citibank NA	2	2.465	0,00
35.269 €	30.421 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	200	0,00
736.449 €	789.705 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	24.320	0,00
21.300.000 €	23.143.313 US$	09.01.2024	Goldman Sachs International	4	391.143	0,02
651.895 €	714.591 US$	04.01.2024	Goldman Sachs International	3	5.553	0,00
2.665.307 €	2.838.755 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	3	107.309	0,01
45.769 £	56.645 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	4	1.706	0,00
1.134.373.800 HUF	3.220.000 US$	09.01.2024	Goldman Sachs International	1	55.647	0,01
9.761.207.920 IDR	628.417 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	4.559	0,00
30.205.046 INR	361.884 US$	08.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	512	0,00
660.557.300 ¥	4.625.000 US$	09.01.2024	Goldman Sachs International	1	64.902	0,01
45.868 ¥	313 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	13	0,00
1.183.194.027 KRW	901.409 US$	20.03.2024	Citibank NA	2	15.241	0,00
6.776.355 MXN	384.733 US$	20.03.2024	Citibank NA	2	10.393	0,00
2.962.327 MYR	643.830 US$	23.01.2024	Barclays Bank Plc	1	2.933	0,00
1.259.700 MYR	271.772 US$	23.01.2024	Goldman Sachs International	2	3.258	0,00
1.652.712 MYR	350.115 US$	23.01.2024	Morgan Stanley	1	10.721	0,00
2.754.387 PEN	720.346 US$	18.01.2024	Barclays Bank Plc	1	23.198	0,00
794.064 PEN	206.637 US$	18.01.2024	Citibank NA	1	7.720	0,00
20.185.857 PHP	360.294 US$	06.02.2024	Goldman Sachs International	1	4.108	0,00
365.125 RON	73.207 €	19.01.2024	Goldman Sachs International	1	137	0,00
118.391 RON	23.736 €	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	45	0,00

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,01 % (31. Dezember 2022: 2,24 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
480.620 SGD	353.101 US$	22.01.2024	Standard Chartered Bank	1	11.594	0,00
32.027.665 THB	912.845 US$	20.03.2024	Citibank NA	2	31.804	0,00
19.808.520 TWD	621.138 US$	12.01.2024	Citibank NA	1	28.813	0,00
11.748.371 TWD	369.190 US$	12.01.2024	Goldman Sachs International	1	16.294	0,00
11.632.691 TWD	371.201 US$	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	10.487	0,00
225.318 US$	290.460.716 KRW	20.03.2024	Goldman Sachs International	1	290	0,00
224.111 US$	201.533 €	05.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.176	0,00
293.470 US$	5.385.013 ZAR	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.000	0,00
5.087.026 UYU	126.417 US$	09.02.2024	Citibank NA	1	3.536	0,00
5.392.285 UYU	134.639 US$	27.03.2024	Citibank NA	1	2.360	0,00
492.131 UYU	12.151 US$	09.02.2024	Goldman Sachs International	1	421	0,00
13.933.693 UYU	342.309 US$	09.02.2024	HSBC Bank Plc	1	13.642	0,00
7.628.085 UYU	190.645 US$	27.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	3.158	0,00
5.378.133 ZAR	282.547 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	9.549	0,00
12.364.126 ZAR	651.129 US$	20.03.2024	Morgan Stanley	1	20.389	0,00
Abgesicherte Klassen AUD						
4.034.977 AUD	2.657.774 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	96.926	0,01
1.111.839 AUD	710.879 US$	18.01.2024	UBS AG	1	48.180	0,00
214.300.190 AUD	138.762.406 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	70	7.541.455	0,37
298 US$	434 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	2	0,00
Abgesicherte Klassen CNY						
2.635.142 CNY	364.477 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	5.999	0,00
93.204.668 CNY	12.878.348 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	55	225.338	0,01
Abgesicherte Klassen EUR						
1.332.999 €	1.436.088 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	37.325	0,00
20.511.292 €	21.875.122 US$	18.01.2024	UBS AG	5	796.779	0,04
31.764.177 €	34.120.129 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	54	990.013	0,05
4 US$	3 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
219.711 £	268.276 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	11.836	0,00
20.308.997 £	24.937.709 US$	18.01.2024	UBS AG	6	954.471	0,05
12.897.007 £	16.129.765 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	52	312.780	0,02
3.748 US$	2.936 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	4	0,00
Abgesicherte Klassen HKD						
17.863.711 HKD	2.286.721 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	1.779	0,00
15.404.629 HKD	1.971.819 US$	18.01.2024	UBS AG	2	1.651	0,00
872.425.056 HKD	111.744.184 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	35	21.259	0,00
367.011 US$	2.863.324 HKD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	10	194	0,00
Abgesicherte Klassen JPY						
791.961.358 ¥	5.442.503 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	188.590	0,01
1.050.510.534 ¥	7.127.779 US$	18.01.2024	UBS AG	6	341.678	0,02

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,01 % (31. Dezember 2022: 2,24 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen JPY (Fortsetzung)						
20.772.724.677 ¥	141.791.589 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	5	5.908.956	0,29
Abgesicherte Klassen SGD						
54.316.641 SGD	39.981.436 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	1.225.725	0,06
581.470 SGD	436.917 US$	18.01.2024	UBS AG	1	4.214	0,00
33.759.477 SGD	25.197.532 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	75	413.998	0,02
161 US$	212 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**20.251.351**	**1,01**

Futures-Kontrakte 0,18 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
(380)	3-Month Euro EURIBOR Future March 2025	13.118	0,00
12	Euro-BTP Future March 2024	56.204	0,00
2	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024	23.949	0,00
30	United Kingdom Long Gilt Future March 2024	247.056	0,01
734	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	2.169.467	0,11
759	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	1.127.581	0,06
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**3.637.375**	**0,18**

Gekaufte Swaptions 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Nominalwert	Fällig-keit	Beschreibung	Gegenpartei	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Put-Swaptions					
20.000.000 EUR	20.03.2024	EUR Swaption, upon potential exercise of the option, the Portfolio will enter into swap with the notional value of EUR 20,000,000, in which it will pay a rate of 5.00%, and will receive iTraxx XO.40.V1, strike rate 6.00%	JPMorgan Chase Bank	15.122	0,00
Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions insgesamt ∞ (Prämie: 52.385 US$)				**15.122**	**0,00**

Credit-Default-Swap-Kontrakten 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Nominalwert		Fällig-keit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
USD	15.523.200	20.12.2028	ICE Clear U.S.[1]	Selling default protection on CDX.NA.HY.41.V2	905.422	0,04
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt ±					**905.422**	**0,04**

[1]Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

Nominalwert		Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
CAD	13.647.000	17.02.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	2,67 %	3M CDOR	338.271	0,02

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,03 %) (Fortsetzung)

Nominalwert		Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)[#]	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
SEK	86.363.000	21.11.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	3,15 %	3M STIBOR	293.259	0,01
AUD	3.461.661	07.12.2053	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,47 %	6M BBSW	141.936	0,01
SEK	28.899.000	11.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,65 %	3M STIBOR	35.148	0,00
BRL	2.262.674	02.01.2031	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	11,21 %	1D BROIS	26.313	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten ∞							**834.927**	**0,04**

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Total Return Swap-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Nominalwert		Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
USD	38.600.000	20.03.2024	5,38[1]	iBoxx USD Liquid High Yield Index[2]	376.211	0,02
USD	35.080.000	20.03.2024	5,38[1]	iBoxx USD Liquid Investment Grade Index[2]	85.374	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten ∞					**461.585**	**0,02**

[1] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.
[2] Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Goldman Sachs International.

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**2.163.075.623**	**107,10**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,27 %) (31. Dezember 2022: (0,54 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
2.784.495.000 CLP	3.220.000 US$	09.01.2024	Goldman Sachs International	1	(31.877)	(0,00)
304.877 €	264.600 £	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(350)	(0,00)
9.031.706 €	10.000.000 US$	31.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(11.152)	(0,00)
226.898.908 HUF	592.121 €	06.02.2024	Goldman Sachs International	1	(2.452)	(0,00)
4.759.799 PLN	1.092.711 €	20.03.2024	HSBC Bank Plc	2	(1.680)	(0,00)
185.320 US$	171.847 €	04.01.2024	Barclays Bank Plc	1	(4.518)	(0,00)
877.586 US$	802.035 €	05.02.2024	Barclays Bank Plc	1	(9.623)	(0,00)
994.341 US$	31.448.970 TWD	12.01.2024	Citibank NA	2	(37.553)	(0,00)
352.631 US$	480.594 SGD	22.01.2024	Citibank NA	1	(12.044)	(0,00)
73.766 US$	373.519 BRL	25.01.2024	Citibank NA	1	(3.021)	(0,00)
228.558 US$	7.900.169 THB	20.03.2024	Citibank NA	1	(4.455)	(0,00)
65.850 US$	60.697 €	04.01.2024	Citibank NA	1	(1.201)	(0,00)
173.506 US$	866.035 BRL	03.04.2024	Citibank NA	1	(3.281)	(0,00)

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,27 %) (31. Dezember 2022: (0,54 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
544.912 US$	2.209.720.488 COP	01.02.2024	Goldman Sachs International	1	(21.812)	(0,00)
5.697.250 US$	5.244.119 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	(99.272)	(0,01)
5.320.388 US$	4.235.178 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(79.090)	(0,01)
656.541 US$	4.670.139 CNY	20.03.2024	Goldman Sachs International	1	(2.851)	(0,00)
335.959 US$	1.284.990 PEN	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(10.922)	(0,00)
348.558 US$	1.652.930 MYR	23.01.2024	Goldman Sachs International	1	(12.326)	(0,00)
377.922 US$	11.712.557 TWD	12.01.2024	Goldman Sachs International	1	(6.387)	(0,00)
1.414.813 US$	1.298.056 €	04.01.2024	Goldman Sachs International	4	(19.141)	(0,00)
32.000.000 US$	29.743.370 €	09.01.2024	Goldman Sachs International	1	(863.569)	(0,04)
54.079 US$	50.291 €	04.01.2024	HSBC Bank Plc	1	(1.477)	(0,00)
196.502 US$	995.791 BRL	25.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(8.209)	(0,00)
266.855 US$	243.713 €	04.01.2024	Morgan Stanley	1	(2.373)	(0,00)
574.317 US$	2.150.531 PEN	18.01.2024	Morgan Stanley	1	(6.216)	(0,00)
7.349.774 US$	5.987.600 £	18.01.2024	Royal Bank of Canada	3	(283.887)	(0,02)
7.292.459 US$	134.909.994 MXN	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(653.407)	(0,03)
48.584.642 US$	45.465.190 €	18.01.2024	Royal Bank of Canada	4	(1.669.740)	(0,08)
4.900 US$	52.924 NOK	18.01.2024	UBS AG	1	(313)	(0,00)
Abgesicherte Klassen AUD						
222.785 AUD	152.931 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(834)	(0,00)
1.391.960 US$	2.191.234 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(104.006)	(0,01)
1.607.982 US$	2.515.763 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	24	(109.544)	(0,01)
Abgesicherte Klassen CNY						
32.140.088 CNY	4.519.360 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	7	(770)	(0,00)
81.336 US$	591.954 CNY	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(1.886)	(0,00)
635.472 US$	4.587.361 CNY	18.01.2024	Westpac Banking Corp	11	(9.467)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
49.109 €	54.570 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(288)	(0,00)
649.690 US$	611.772 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(26.525)	(0,00)
4.822.625 US$	4.500.144 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	55	(151.555)	(0,01)
Abgesicherte Klassen GBP						
273.254 £	349.523 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(1.149)	(0,00)
2.785.686 £	3.551.700 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(195)	(0,00)
325.910 US$	267.104 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(14.624)	(0,00)
134.772 US$	110.678 £	18.01.2024	UBS AG	1	(6.333)	(0,00)
3.018.266 US$	2.425.311 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	23	(73.791)	(0,00)
Abgesicherte Klassen HKD						
18.544.116 HKD	2.376.874 US$	18.01.2024	UBS AG	3	(1.207)	(0,00)
73.597.039 HKD	9.437.911 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	22	(9.471)	(0,00)
416.655 US$	3.255.015 HKD	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(342)	(0,00)
983.692 US$	7.683.862 HKD	18.01.2024	UBS AG	2	(680)	(0,00)

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,27 %) (31. Dezember 2022: (0,54 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen HKD (Fortsetzung)						
4.299.957 US$	33.592.199 HKD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	32	(3.502)	(0,00)
Abgesicherte Klassen JPY						
694.284 US$	103.324.572 ¥	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(40.386)	(0,00)
1.476.370 US$	218.422.043 ¥	18.01.2024	UBS AG	2	(76.678)	(0,00)
28.568.433 US$	4.148.924.645 ¥	18.01.2024	Westpac Banking Corp	14	(931.713)	(0,05)
Abgesicherte Klassen SGD						
600.524 SGD	455.770 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(184)	(0,00)
213.559 US$	291.622 SGD	18.01.2024	UBS AG	1	(7.679)	(0,00)
2.499.059 US$	3.395.079 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	41	(76.607)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(5.513.615)**	**(0,27)**

Futures-Kontrakte (0,92 %) (31. Dezember 2022: (0,11 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
(52)	10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2024	(48.070)	(0,00)
(42)	3 Month SOFR Future March 2025	(5.775)	(0,00)
(70)	Euro-BOBL Future March 2024	(117.105)	(0,01)
(58)	Euro-Bund Future March 2024	(247.950)	(0,01)
(3)	Euro-OAT Future March 2024	(15.045)	(0,00)
(128)	Euro-Schatz Future March 2024	(91.907)	(0,01)
88	US Treasury 10-Year Ultra Future March 2024	(2.750)	(0,00)
(731)	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024	(415.296)	(0,02)
(503)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024	(5.057.508)	(0,25)
(974)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	(12.575.062)	(0,62)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(18.576.468)**	**(0,92)**

Zinsswap-Kontrakte (0,06 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
NOK	19.762.621	08.12.2053	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	2,75 %	6M NIBOR	(26.198)	(0,00)
SEK	6.206.000	11.12.2053	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	2,33 %	3M STIBOR	(27.686)	(0,00)
BRL	3.860.376	04.01.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	6,17 %	1D BROIS	(182.191)	(0,01)
BRL	6.266.079	02.01.2025	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	6,17 %	1D BROIS	(231.487)	(0,01)
SEK	19.244.000	20.11.2053	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	2,80 %	3M STIBOR	(279.848)	(0,02)
CAD	13.647.000	17.02.2027	Chicago Mercantile Exchange[1]	(Zahlung)	2,67 %	3M CDOR	(338.271)	(0,02)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten ∞							**(1.085.681)**	**(0,06)**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.

(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.

[1]Zentral abgewickelter Swap.

Strategic Income - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(25.175.764)**	**(1,25)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**2.137.899.859**	**105,85**
Sonstige Nettoverbindlichkeiten	**(118.296.278)**	**(5,85)**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**2.019.603.581**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	370.662.889	15,63
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	1.690.318.366	71,26
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	15.222.132	0,64
µ	Investmentfonds	60.766.454	2,56
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(14.939.093)	(0,63)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	15.869.111	0,67
Anlagen insgesamt		**2.137.899.859**	**90,13**

Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Unternehmensanleihen 85,29 % (31. Dezember 2022: 86,13 %)				
	US-Dollar				
240.000	Adani Green Energy Ltd*	4,38 %	08.09.2024	231.889	0,81
600.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ*	6,25 %	10.12.2024	593.638	2,08
500.000	Agile Group Holdings Ltd**	6,05 %	13.10.2025	62.500	0,22
400.000	Axis Bank Ltd*	4,10 %	29.12.2049	365.433	1,28
400.000	Bangkok Bank PCL**	3,73 %	25.09.2034	355.844	1,25
300.000	Bangkok Bank PCL**	5,00 %	29.12.2049	287.496	1,01
400.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**	3,75 %	30.03.2026	382.379	1,34
400.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	4,30 %	29.12.2049	355.413	1,24
250.000	Bank of East Asia Ltd*	5,83 %	29.12.2049	218.750	0,77
450.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00 %	29.12.2049	389.070	1,36
200.000	Champion Path Holdings Ltd**	4,85 %	27.01.2028	171.931	0,60
200.000	China Hongqiao Group Ltd*	6,25 %	08.06.2024	198.770	0,70
700.000	China SCE Group Holdings Ltd**	7,00 %	02.05.2025	44.100	0,15
623.875	Continuum Energy Levanter Pte Ltd**	4,50 %	09.02.2027	587.140	2,06
500.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38 %	12.05.2026	469.196	1,64
200.000	ENN Energy Holdings Ltd**	2,63 %	17.09.2030	171.295	0,60
200.000	Fortune Star BVI Ltd**	5,00 %	18.05.2026	146.710	0,51
200.000	Fortune Star BVI Ltd*	5,95 %	19.10.2025	166.737	0,58
500.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25 %	23.07.2029	325.514	1,14
200.000	FWD Group Holdings Ltd**	6,38 %	29.12.2049	177.000	0,62
200.000	FWD Group Holdings Ltd**	8,05 %	29.12.2049	182.848	0,64
200.000	GENM Capital Labuan Ltd*	3,88 %	19.04.2031	170.820	0,60
729.000	Globe Telecom Inc*	4,20 %	29.12.2049	690.203	2,42
300.000	GLP Pte Ltd*	4,50 %	29.12.2049	96.181	0,34
370.000	Greenko Dutch BV**	3,85 %	29.03.2026	345.367	1,21
1.260.000	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	1.139.040	3,99
300.000	Greenko Solar Mauritius Ltd*	5,95 %	29.07.2026	290.850	1,02
200.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd**	3,38 %	04.02.2032	184.496	0,65
400.000	HDFC Bank Ltd**	3,70 %	29.12.2049	365.019	1,28
200.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,25 %	07.11.2027	182.804	0,64
400.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd*	4,75 %	27.04.2027	372.380	1,30
700.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd*	4,50 %	29.05.2029	620.795	2,17
400.000	Huarong Finance II Co Ltd*	4,63 %	03.06.2026	380.520	1,33
200.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,00 %	19.11.2025	193.330	0,68
200.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	198.250	0,69
200.000	Hyundai Capital America**	5,68 %	26.06.2028	203.999	0,71
563.500	JSW Hydro Energy Ltd*	4,13 %	18.05.2031	491.589	1,72
400.000	JSW Steel Ltd*	5,05 %	05.04.2032	345.416	1,21
600.000	Kasikornbank PCL*	3,34 %	02.10.2031	552.216	1,93

Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 85,29 % (31. Dezember 2022: 86,13 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
200.000	Kasikornbank PCL**	5,28 %	29.12.2049	191.728	0,67
200.000	Lenovo Group Ltd*	3,42 %	02.11.2030	176.744	0,62
273.000	Lenovo Group Ltd*	5,83 %	27.01.2028	278.621	0,98
200.000	LG Energy Solution Ltd**	5,75 %	25.09.2028	206.295	0,72
400.000	Longfor Group Holdings Ltd**	3,95 %	16.09.2029	184.403	0,65
500.000	Medco Bell Pte Ltd**	6,38 %	30.01.2027	476.406	1,67
300.000	Medco Oak Tree Pte Ltd**	7,38 %	14.05.2026	298.248	1,04
300.000	Meituan*	3,05 %	28.10.2030	253.434	0,89
900.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,38 %	04.12.2029	796.381	2,79
700.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,75 %	21.07.2028	648.917	2,27
200.000	MGM China Holdings Ltd**	4,75 %	01.02.2027	190.420	0,67
360.000	MGM China Holdings Ltd*	5,88 %	15.05.2026	352.178	1,23
600.000	Network i2i Ltd*	5,65 %	29.12.2049	594.258	2,08
200.000	New Metro Global Ltd*	4,80 %	15.12.2024	79.500	0,28
200.000	NWD Finance BVI Ltd*	4,13 %	29.12.2049	109.000	0,38
350.000	PCPD Capital Ltd*	5,13 %	18.06.2026	277.060	0,97
400.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	394.712	1,38
200.000	Philippine National Bank**	3,28 %	27.09.2024	195.650	0,68
95.000	ReNew Pvt Ltd**	5,88 %	05.03.2027	90.944	0,32
600.000	ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries**	4,50 %	14.07.2028	533.764	1,87
581.000	RKPF Overseas 2020 A Ltd**	5,20 %	12.01.2026	151.490	0,53
600.000	Sands China Ltd**	5,65 %	08.08.2028	595.364	2,08
330.000	Shriram Finance Ltd*	4,40 %	13.03.2024	327.994	1,15
250.000	Shui On Development Holding Ltd**	5,50 %	03.03.2025	143.812	0,50
500.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd**	4,75 %	05.08.2029	33.750	0,12
200.000	SK Hynix Inc*	6,50 %	17.01.2033	211.311	0,74
1.150.000	Standard Chartered Plc*	4,30 %	29.12.2049	937.847	3,28
200.000	Standard Chartered Plc**	4,75 %	29.12.2049	163.217	0,57
200.000	Standard Chartered Plc**	6,00 %	29.12.2049	196.716	0,69
200.000	Standard Chartered Plc*	7,75 %	29.12.2049	204.742	0,72
486.480	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd**	6,75 %	24.04.2033	486.721	1,70
600.000	Studio City Finance Ltd*	6,50 %	15.01.2028	557.295	1,95
400.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95 %	11.03.2025	297.816	1,04
300.000	Wynn Macau Ltd*	5,50 %	01.10.2027	283.655	0,99
600.000	Wynn Macau Ltd*	5,63 %	26.08.2028	556.245	1,95
310.000	Yanlord Land HK Co Ltd**	5,13 %	20.05.2026	180.551	0,63
	Unternehmensanleihen insgesamt			**24.364.117**	**85,29**

Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 8,77 % (31. Dezember 2022: 2,63 %)				
	US-Dollar				
229.000	Industrial Bank of Korea	5,38 %	04.10.2028	236.592	0,83
300.000	Korea Land & Housing Corp	5,75 %	06.10.2025	303.552	1,06
333.000	Philippine Government International Bond	5,00 %	17.07.2033	342.643	1,20
600.000	Sri Lanka Government International Bond	5,75 %	18.04.2023	308.625	1,08
200.000	Sri Lanka Government International Bond	5,88 %	25.07.2024	105.900	0,37
600.000	Sri Lanka Government International Bond	6,13 %	03.06.2025	309.737	1,09
1.150.000	Sri Lanka Government International Bond	6,85 %	03.11.2025	595.122	2,08
600.000	Sri Lanka Government International Bond	7,55 %	28.03.2030	302.923	1,06
	Staatsanleihen insgesamt *			**2.505.094**	**8,77**
	Anlagen insgesamt			**26.869.211**	**94,06**

Devisenterminkontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,88 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
4.181 €	4.531 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	90	0,00
5.589 €	6.008 US$	18.01.2024	UBS AG	2	171	0,00
377.678 €	402.555 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	6	14.906	0,05
Abgesicherte Klassen GBP						
447 £	555 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	15	0,00
312 £	383 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	15	0,00
18.180 £	22.335 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	843	0,00
18.545 £	22.774 US$	18.01.2024	UBS AG	3	869	0,01
641 £	801 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	17	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**16.926**	**0,06**

Futures-Kontrakte 0,09 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
2	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	23.897	0,09
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**23.897**	**0,09**

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**26.910.034**	**94,21**

Sustainable Asia High Yield - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,09 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
2.802 US$	2.635 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(111)	(0,00)
22.754 US$	20.921 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(370)	(0,00)
Abgesicherte Klassen GBP						
318 US$	261 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(15)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(496)**	**(0,00)**

Futures-Kontrakte (0,21 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
(16)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	(58.271)	(0,21)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(58.271)**	**(0,21)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(58.767)**	**(0,21)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**26.851.267**	**94,00**
Sonstiges Nettovermögen	**1.713.684**	**6,00**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**28.564.951**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	18.881.608	65,80
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	7.987.603	27,84
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(34.374)	(0,12)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	16.430	0,06
Anlagen insgesamt		**26.851.267**	**93,58**

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %)				
	US-Dollar				
268.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	4,50 %	14.09.2027	263.727	0,27
450.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC[*]	5,38 %	18.07.2028	457.133	0,47
330.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC[*]	5,50 %	12.01.2029	336.825	0,34
205.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC[**]	8,00 %	29.12.2049	218.170	0,22
300.000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC[*]	4,60 %	02.11.2047	276.098	0,28
200.000	Access Bank Plc[*]	6,13 %	21.09.2026	180.530	0,18
245.405	Acu Petroleo Luxembourg Sarl[**]	7,50 %	13.01.2032	233.050	0,24
500.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energ[*]	6,25 %	10.12.2024	494.698	0,51
640.000	Adib Sukuk Co II Ltd[*]	5,70 %	15.11.2028	658.381	0,67
217.000	Africa Finance Corp[*]	2,88 %	28.04.2028	190.417	0,19
303.000	AIA Group Ltd[*]	2,70 %	29.12.2049	276.444	0,28
300.000	AIA Group Ltd[**]	3,60 %	09.04.2029	283.957	0,29
200.000	AIA Group Ltd[**]	4,95 %	04.04.2033	201.530	0,21
352.000	Akbank TAS[**]	6,80 %	06.02.2026	354.145	0,36
320.000	Aldar Investment Properties Sukuk Ltd[*]	4,88 %	24.05.2033	312.389	0,32
362.723	Alfa Desarrollo SpA[**]	4,55 %	27.09.2051	283.533	0,29
450.000	Alfa SAB de CV[**]	6,88 %	25.03.2044	448.999	0,46
264.000	Almarai Co JSC[*]	5,23 %	25.07.2033	267.699	0,27
206.000	Alsea SAB de CV[**]	7,75 %	14.12.2026	210.489	0,22
200.000	Altice Financing SA[*]	5,00 %	15.01.2028	181.338	0,19
200.000	Altice Financing SA[**]	5,75 %	15.08.2029	177.923	0,18
300.000	America Movil SAB de CV[*]	3,63 %	22.04.2029	283.499	0,29
300.000	America Movil SAB de CV[*]	4,70 %	21.07.2032	295.097	0,30
450.000	Anglo American Capital Plc[*]	3,88 %	16.03.2029	422.945	0,43
200.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc[*]	3,38 %	01.11.2028	180.174	0,18
260.000	AngloGold Ashanti Holdings Plc[*]	3,75 %	01.10.2030	226.244	0,23
388.000	Antofagasta Plc[*]	5,63 %	13.05.2032	390.487	0,40
200.000	Axiata Spv5 Labuan Ltd[*]	3,06 %	19.08.2050	138.330	0,14
300.000	Axis Bank Ltd[*]	4,10 %	29.12.2049	274.075	0,28
175.000	Azul Secured Finance LLP[**]	10,88 %	28.05.2030	144.827	0,15
400.000	Banco Davivienda SA[**]	6,65 %	29.12.2049	286.500	0,29
400.000	Banco de Bogota SA[*]	6,25 %	12.05.2026	395.254	0,40
300.000	Banco de Chile[**]	2,99 %	09.12.2031	258.478	0,26
200.000	Banco de Credito del Peru SA[**]	3,13 %	01.07.2030	190.413	0,19
500.000	Banco de Credito e Inversiones SA[**]	2,88 %	14.10.2031	424.340	0,43
351.000	Banco do Brasil SA[**]	6,25 %	18.04.2030	365.491	0,37
300.000	Banco Internacional del Peru SAA Interbank[**]	3,25 %	04.10.2026	283.297	0,29
200.000	Banco Mercantil del Norte SA[*]	7,50 %	29.12.2049	188.942	0,19
250.000	Banco Mercantil del Norte SA[*]	7,63 %	29.12.2049	240.533	0,25
241.000	Banco Santander Chile[**]	3,18 %	26.10.2031	208.953	0,21

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
395.000	Bancolombia SA*	4,63 %	18.12.2029	366.455	0,38
848.000	Bangkok Bank PCL**	3,73 %	25.09.2034	754.389	0,77
225.000	Bangkok Bank PCL**	5,00 %	29.12.2049	215.622	0,22
250.000	Bank Hapoalim BM*	3,26 %	21.01.2032	217.323	0,22
285.000	Bank Leumi Le-Israel BM**	3,28 %	29.01.2031	258.338	0,26
333.000	Bank Muscat SAOG*	4,75 %	17.03.2026	326.742	0,33
213.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT**	3,75 %	30.03.2026	203.794	0,21
200.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT*	4,30 %	29.12.2049	177.706	0,18
400.000	BBVA Bancomer SA**	5,13 %	18.01.2033	362.716	0,37
249.000	Bidvest Group UK Plc*	3,63 %	23.09.2026	231.570	0,24
700.000	BOC Aviation Ltd*	3,00 %	11.09.2029	630.038	0,64
405.000	BOC Aviation Ltd**	3,50 %	18.09.2027	385.460	0,39
240.000	BOC Aviation Ltd*	4,50 %	23.05.2028	235.620	0,24
200.000	BOC Aviation USA Corp**	4,88 %	03.05.2033	195.947	0,20
200.000	Borr IHC Ltd/Borr Finance LLC**	10,00 %	15.11.2028	209.000	0,21
200.000	Braskem Idesa SAPI**	6,99 %	20.02.2032	113.162	0,12
400.000	BRF SA**	4,88 %	24.01.2030	352.161	0,36
385.000	BSF Finance*	5,50 %	23.11.2027	391.256	0,40
400.000	Canacol Energy Ltd**	5,75 %	24.11.2028	292.095	0,30
200.000	CAS Capital No 1 Ltd*	4,00 %	29.12.2049	172.920	0,18
321.000	CBQ Finance Ltd*	2,00 %	12.05.2026	296.302	0,30
200.000	CDBL Funding 2*	2,00 %	04.03.2026	188.096	0,19
400.000	Cemex SAB de CV**	5,13 %	29.12.2049	379.672	0,39
534.000	Cemex SAB de CV**	9,13 %	29.12.2049	569.378	0,58
300.000	Cencosud SA*	4,38 %	17.07.2027	289.640	0,30
300.000	Central American Bottling Corp/CBC Bottling Holdco SL/Beliv Holdco SL**	5,25 %	27.04.2029	282.042	0,29
200.000	Champion Path Holdings Ltd**	4,85 %	27.01.2028	172.315	0,18
200.000	China Cinda Finance 2017 I Ltd*	4,75 %	08.02.2028	195.723	0,20
200.000	China Development Bank Financial Leasing Co Ltd*	2,88 %	28.09.2030	189.461	0,19
350.000	China Hongqiao Group Ltd*	6,25 %	08.06.2024	347.560	0,36
200.000	China Overseas Finance Cayman VI Ltd**	6,45 %	11.06.2034	207.303	0,21
200.000	China SCE Group Holdings Ltd**	7,00 %	02.05.2025	12.600	0,01
300.000	Cibanco SA Ibm/PLA Administradora Industrial S de RL de CV**	4,96 %	18.07.2029	286.559	0,29
200.000	CK Hutchison International 21 Ltd*	2,50 %	15.04.2031	171.577	0,18
400.000	CK Hutchison International 23 Ltd*	4,88 %	21.04.2033	401.617	0,41
320.000	CMB International Leasing Management Ltd*	1,88 %	12.08.2025	303.577	0,31
390.000	Commercial Bank of Dubai PSC*	5,32 %	14.06.2028	389.727	0,40
200.000	Commercial Bank PSQC*	4,50 %	29.12.2049	183.482	0,19

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
200.000	Compania Cervecerias Unidas SA**	3,35 %	19.01.2032	172.373	0,18
200.000	Compania de Minas Buenaventura SAA**	5,50 %	23.07.2026	191.108	0,20
267.375	Continuum Energy Levanter Pte Ltd**	4,50 %	09.02.2027	251.631	0,26
239.000	CSN Inova Ventures**	6,75 %	28.01.2028	233.697	0,24
400.000	CSN Resources SA**	4,63 %	10.06.2031	327.541	0,34
555.000	CT Trust**	5,13 %	03.02.2032	485.657	0,50
300.000	DBS Group Holdings Ltd**	1,82 %	10.03.2031	278.277	0,28
323.000	DIB Sukuk Ltd*	1,96 %	22.06.2026	300.554	0,31
322.000	DIB Sukuk Ltd*	4,80 %	16.08.2028	319.753	0,33
308.000	DIB Sukuk Ltd*	5,49 %	30.11.2027	314.202	0,32
250.000	DIB Tier 1 Sukuk 3 Ltd*	6,25 %	29.12.2049	249.405	0,26
273.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,13 %	30.06.2028	236.554	0,24
263.000	Ecopetrol SA**	4,63 %	02.11.2031	223.393	0,23
480.000	Ecopetrol SA**	5,88 %	28.05.2045	379.679	0,39
200.000	Ecopetrol SA**	6,88 %	29.04.2030	198.437	0,20
300.000	Ecopetrol SA**	7,38 %	18.09.2043	286.688	0,29
687.000	Ecopetrol SA*	8,88 %	13.01.2033	747.220	0,76
300.000	EIG Pearl Holdings Sarl*	3,55 %	31.08.2036	262.013	0,27
224.000	EIG Pearl Holdings Sarl*	4,39 %	30.11.2046	180.410	0,18
292.000	Emaar Sukuk Ltd*	3,88 %	17.09.2029	269.177	0,28
200.000	Emirates NBD Bank PJSC**	4,25 %	29.12.2049	180.500	0,18
329.000	Emirates NBD Bank PJSC*	5,63 %	21.10.2027	334.795	0,34
200.000	Emirates NBD Bank PJSC*	5,88 %	11.10.2028	207.008	0,21
300.000	Emirates NBD Bank PJSC*	6,13 %	29.12.2049	298.701	0,31
205.000	Enel Chile SA*	4,88 %	12.06.2028	202.726	0,21
200.000	Energian Israel Finance Ltd**	4,88 %	30.03.2026	184.850	0,19
100.000	Energian Israel Finance Ltd**	5,88 %	30.03.2031	84.672	0,09
480.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd*	3,38 %	12.05.2026	450.428	0,46
500.000	ENN Energy Holdings Ltd**	2,63 %	17.09.2030	428.238	0,44
206.000	First Abu Dhabi Bank PJSC*	5,13 %	13.10.2027	207.792	0,21
233.000	First Abu Dhabi Bank PJSC*	6,32 %	04.04.2034	240.345	0,25
300.000	Formosa Group Cayman Ltd**	3,38 %	22.04.2025	292.986	0,30
400.000	Franshion Brilliant Ltd*	4,25 %	23.07.2029	260.587	0,27
350.000	FS Luxembourg Sarl**	10,00 %	15.12.2025	359.174	0,37
300.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,63 %	31.03.2036	248.126	0,25
279.936	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd*	2,94 %	30.09.2040	230.842	0,24
600.000	GC Treasury Center Co Ltd*	2,98 %	18.03.2031	507.777	0,52
380.000	GC Treasury Center Co Ltd*	4,40 %	30.03.2032	347.314	0,36

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
234.000	GCC SAB de CV**	3,61 %	20.04.2032	201.802	0,21
400.000	GENM Capital Labuan Ltd*	3,88 %	19.04.2031	341.639	0,35
360.000	Globe Telecom Inc*	4,20 %	29.12.2049	340.900	0,35
370.000	Greenko Dutch BV**	3,85 %	29.03.2026	345.368	0,36
630.000	Greenko Power II Ltd*	4,30 %	13.12.2028	569.520	0,59
200.000	Greensaif Pipelines Bidco Sarl*	6,51 %	23.02.2042	211.505	0,22
300.000	Grupo Aval Ltd*	4,38 %	04.02.2030	255.060	0,26
300.000	Grupo Televisa SAB*	6,63 %	15.01.2040	314.451	0,32
257.037	Guara Norte Sarl**	5,20 %	15.06.2034	234.444	0,24
300.000	Hanwha Life Insurance Co Ltd**	3,38 %	04.02.2032	276.745	0,28
245.000	HDFC Bank Ltd**	3,70 %	29.12.2049	223.574	0,23
203.000	HPHT Finance 21 Ltd**	2,00 %	19.03.2026	190.011	0,19
575.000	Huarong Finance II Co Ltd*	5,50 %	16.01.2025	569.969	0,58
200.000	Hunt Oil Co of Peru LLC Sucursal Del Peru**	8,55 %	18.09.2033	218.883	0,22
300.000	Hyundai Capital America**	3,50 %	02.11.2026	285.516	0,29
200.000	IHS Holding Ltd**	5,63 %	29.11.2026	174.597	0,18
291.000	IHS Netherlands Holdco BV**	8,00 %	18.09.2027	260.142	0,27
216.000	Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT**	3,40 %	09.06.2031	187.157	0,19
300.000	InRetail Consumer**	3,25 %	22.03.2028	269.471	0,28
300.000	Inversiones CMPC SA**	3,00 %	06.04.2031	255.331	0,26
266.000	Inversiones CMPC SA**	6,13 %	23.06.2033	275.583	0,28
200.000	Investment Energy Resources Ltd*	6,25 %	26.04.2029	189.117	0,19
200.000	Itau Unibanco Holding SA*	3,88 %	15.04.2031	191.697	0,20
161.000	JSW Hydro Energy Ltd*	4,13 %	18.05.2031	140.454	0,14
240.000	JSW Steel Ltd*	5,05 %	05.04.2032	207.249	0,21
350.000	Kallpa Generacion SA*	4,13 %	16.08.2027	334.813	0,34
200.000	Kasikornbank PCL*	3,34 %	02.10.2031	184.222	0,19
245.000	Kasikornbank PCL*	5,46 %	07.03.2028	249.915	0,26
300.000	KazMunayGas National Co JSC*	3,50 %	14.04.2033	250.073	0,26
600.000	KazMunayGas National Co JSC*	4,75 %	19.04.2027	584.697	0,60
200.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,38 %	24.04.2030	198.766	0,20
550.000	KazMunayGas National Co JSC*	5,75 %	19.04.2047	483.490	0,49
207.000	Khazanah Capital Ltd*	4,88 %	01.06.2033	208.131	0,21
200.000	Klabin Austria GmbH*	7,00 %	03.04.2049	202.335	0,21
223.000	Kookmin Bank**	2,50 %	04.11.2030	185.854	0,19
700.000	Kosmos Energy Ltd*	7,13 %	04.04.2026	668.015	0,68
200.000	Kyobo Life Insurance Co Ltd*	5,90 %	15.06.2052	197.406	0,20
75.000	Latam Airlines Group SA**	13,38 %	15.10.2029	85.961	0,09

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
400.000	Lenovo Group Ltd*	3,42 %	02.11.2030	353.489	0,36
309.038	Leviathan Bond Ltd*	6,75 %	30.06.2030	282.942	0,29
229.000	LG Chem Ltd*	2,38 %	07.07.2031	189.531	0,19
200.000	LG Energy Solution Ltd**	5,75 %	25.09.2028	206.295	0,21
258.000	MAF Global Securities Ltd*	7,88 %	29.12.2049	263.919	0,27
200.000	MAF Sukuk Ltd*	4,64 %	14.05.2029	196.522	0,20
400.000	MARB BondCo Plc*	3,95 %	29.01.2031	325.263	0,33
369.108	MC Brazil Downstream Trading Sarl**	7,25 %	30.06.2031	289.728	0,30
600.000	Medco Bell Pte Ltd**	6,38 %	30.01.2027	571.687	0,58
200.000	MEGlobal BV**	2,63 %	28.04.2028	180.414	0,18
322.000	MEGlobal Canada ULC*	5,88 %	18.05.2030	331.948	0,34
750.000	Melco Resorts Finance Ltd**	5,63 %	17.07.2027	703.588	0,72
550.000	Melco Resorts Finance Ltd*	5,75 %	21.07.2028	509.863	0,52
267.000	Mersin Uluslararasi Liman Isletmeciligi AS*	8,25 %	15.11.2028	279.140	0,29
200.000	MGM China Holdings Ltd**	4,75 %	01.02.2027	190.420	0,20
200.000	MHP Lux SA*	6,95 %	03.04.2026	155.500	0,16
250.000	Millicom International Cellular SA**	4,50 %	27.04.2031	207.935	0,21
315.000	Millicom International Cellular SA*	6,25 %	25.03.2029	298.861	0,31
679.000	Minera Mexico SA de CV**	4,50 %	26.01.2050	548.280	0,56
494.000	Minerva Luxembourg SA*	4,38 %	18.03.2031	407.775	0,42
200.000	Minerva Luxembourg SA**	8,88 %	13.09.2033	211.809	0,22
300.000	Minsur SA**	4,50 %	28.10.2031	265.479	0,27
300.000	MTN Mauritius Investments Ltd*	6,50 %	13.10.2026	303.294	0,31
403.180	MV24 Capital BV*	6,75 %	01.06.2034	377.705	0,39
215.673	Nakilat Inc**	6,07 %	31.12.2033	222.872	0,23
388.000	NBK SPC Ltd*	1,63 %	15.09.2027	351.855	0,36
359.000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd*	4,50 %	29.12.2049	345.234	0,35
200.000	Nemak SAB de CV**	3,63 %	28.06.2031	166.295	0,17
200.000	Network i2i Ltd*	5,65 %	29.12.2049	198.086	0,20
343.000	Nexa Resources SA**	6,50 %	18.01.2028	346.859	0,35
294.000	Ooredoo International Finance Ltd*	2,63 %	08.04.2031	256.867	0,26
300.000	Orbia Advance Corp SAB de CV*	5,88 %	17.09.2044	272.492	0,28
200.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd**	1,83 %	10.09.2030	188.208	0,19
262.000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd*	4,60 %	15.06.2032	258.940	0,27
283.000	Oztel Holdings SPC Ltd*	6,63 %	24.04.2028	296.549	0,30
300.000	Periama Holdings LLC*	5,95 %	19.04.2026	296.322	0,30
200.000	Power Finance Corp Ltd*	3,95 %	23.04.2030	185.183	0,19
400.000	Prosus NV*	3,83 %	08.02.2051	251.599	0,26

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
200.000	Prosus NV*	4,19 %	19.01.2032	172.693	0,18
400.000	Prudential Funding Asia Plc*	2,95 %	03.11.2033	352.278	0,36
241.000	QNB Finance Ltd*	2,63 %	12.05.2025	231.793	0,24
367.000	QNB Finance Ltd*	2,75 %	12.02.2027	342.870	0,35
390.000	REC Ltd*	2,25 %	01.09.2026	360.582	0,37
295.000	Rede D'or Finance Sarl**	4,50 %	22.01.2030	267.505	0,27
450.000	Reliance Industries Ltd*	2,88 %	12.01.2032	385.866	0,39
378.000	Reliance Industries Ltd*	3,63 %	12.01.2052	277.783	0,28
400.000	ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd other 9 Subsidiaries**	4,50 %	14.07.2028	355.843	0,36
337.000	SABIC Capital I BV*	2,15 %	14.09.2030	288.589	0,30
231.000	Sable International Finance Ltd**	5,75 %	07.09.2027	218.420	0,22
200.000	Sagicor Financial Co Ltd**	5,30 %	13.05.2028	192.212	0,20
340.000	Samarco Mineracao SA**	9,50 %	30.06.2031	285.940	0,29
200.000	Sands China Ltd**	4,30 %	08.01.2026	192.197	0,20
275.000	Sands China Ltd*	5,38 %	08.08.2025	271.370	0,28
950.000	Sands China Ltd**	5,65 %	08.08.2028	942.660	0,96
327.000	Sasol Financing USA LLC*	8,75 %	03.05.2029	333.972	0,34
475.000	SEPLAT Energy Plc*	7,75 %	01.04.2026	437.950	0,45
232.000	SF Holding Investment 2021 Ltd*	3,13 %	17.11.2031	201.587	0,21
282.000	Shelf Drilling Holdings Ltd**	9,63 %	15.04.2029	276.165	0,28
600.000	Shinhan Bank Co Ltd*	4,38 %	13.04.2032	556.270	0,57
350.000	Shinhan Bank Co Ltd**	4,50 %	12.04.2028	347.403	0,36
200.000	Siam Commercial Bank PCL**	4,40 %	11.02.2029	194.263	0,20
400.000	SierraCol Energy Andina LLC**	6,00 %	15.06.2028	336.976	0,34
400.000	SingTel Group Treasury Pte Ltd**	1,88 %	10.06.2030	339.803	0,35
200.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd**	4,75 %	05.08.2029	13.500	0,01
400.000	Sitios Latinoamerica SAB de CV**	5,38 %	04.04.2032	372.219	0,38
208.000	SK Battery America Inc**	2,13 %	26.01.2026	192.492	0,20
566.000	SK Hynix Inc*	2,38 %	19.01.2031	459.429	0,47
266.000	SK Hynix Inc*	6,38 %	17.01.2028	274.934	0,28
225.000	SK Hynix Inc*	6,50 %	17.01.2033	237.724	0,24
300.000	SNB Funding Ltd*	2,90 %	29.01.2027	281.547	0,29
446.000	SNB Sukuk Ltd*	2,34 %	19.01.2027	412.793	0,42
200.000	Standard Chartered Plc*	1,46 %	14.01.2027	183.334	0,19
400.000	Standard Chartered Plc*	4,30 %	29.12.2049	326.208	0,33
300.000	Standard Chartered Plc*	6,30 %	09.01.2029	307.818	0,32
483.000	Standard Chartered Plc*	6,30 %	06.07.2034	507.589	0,52
200.000	Star Energy Geothermal Darajat II/Star Energy Geothermal Salak*	4,85 %	14.10.2038	183.417	0,19

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
400.000	Studio City Finance Ltd*	6,50 %	15.01.2028	371.530	0,38
200.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd**	3,75 %	25.02.2029	188.219	0,19
276.000	Suzano Austria GmbH**	7,00 %	16.03.2047	292.190	0,30
129.000	Telecom Argentina SA**	8,00 %	18.07.2026	122.521	0,13
400.000	Telecomunicaciones Digitales SA**	4,50 %	30.01.2030	345.160	0,35
390.000	Telefonica Celular del Paraguay SA**	5,88 %	15.04.2027	380.016	0,39
200.000	Telefonica Moviles Chile SA**	3,54 %	18.11.2031	147.897	0,15
283.000	Tencent Holdings Ltd*	3,24 %	03.06.2050	188.961	0,19
429.000	Tengizchevroil Finance Co International Ltd**	3,25 %	15.08.2030	354.534	0,36
500.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	3,15 %	01.10.2026	463.317	0,47
550.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV*	4,10 %	01.10.2046	373.061	0,38
300.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV**	8,13 %	15.09.2031	327.549	0,34
910.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd*	3,75 %	18.06.2050	642.036	0,66
200.000	Total Play Telecomunicaciones SA de CV*	6,38 %	20.09.2028	81.506	0,08
150.000	Transportadora de Gas del Sur SA*	6,75 %	02.05.2025	143.627	0,15
200.000	Trust Fibra Uno**	6,95 %	30.01.2044	172.760	0,18
500.000	TSMC Arizona Corp*	1,75 %	25.10.2026	461.090	0,47
400.000	TSMC Arizona Corp*	2,50 %	25.10.2031	344.571	0,35
550.000	TSMC Arizona Corp*	3,25 %	25.10.2051	436.133	0,45
893.000	TSMC Arizona Corp*	4,25 %	22.04.2032	880.553	0,90
500.000	TSMC Global Ltd*	1,75 %	23.04.2028	446.285	0,46
1.000.000	TSMC Global Ltd*	2,25 %	23.04.2031	852.281	0,87
200.000	Turk Telekomunikasyon AS*	6,88 %	28.02.2025	198.300	0,20
400.000	Turkcell Iletisim Hizmetleri AS*	5,80 %	11.04.2028	380.384	0,39
200.000	Turkiye Petrol Rafinerileri AS*	4,50 %	18.10.2024	196.978	0,20
215.000	Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari AS*	6,95 %	14.03.2026	214.596	0,22
657.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	5,50 %	01.10.2026	630.671	0,65
361.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	9,00 %	12.10.2028	379.462	0,39
400.000	United Overseas Bank Ltd*	2,00 %	14.10.2031	364.605	0,37
300.000	United Overseas Bank Ltd*	3,75 %	15.04.2029	298.526	0,31
500.000	United Overseas Bank Ltd*	3,86 %	07.10.2032	478.385	0,49
302.000	Vale Overseas Ltd*	6,13 %	12.06.2033	313.829	0,32
185.000	Vale Overseas Ltd*	6,88 %	21.11.2036	202.053	0,21
600.000	Vedanta Resources Finance II Plc*	8,95 %	11.03.2025	446.724	0,46
721.000	VTR Finance NV**	6,38 %	15.07.2028	188.766	0,19
280.000	WE Soda Investments Holding Plc**	9,50 %	06.10.2028	289.744	0,30
200.000	Wharf REIC Finance BVI Ltd*	3,50 %	17.01.2028	188.230	0,19
300.000	Woori Bank*	4,75 %	30.04.2024	299.043	0,31

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 85,35 % (31. Dezember 2022: 88,54 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
985.000	Wynn Macau Ltd*	5,63 %	26.08.2028	913.168	0,93
200.000	XP Inc**	3,25 %	01.07.2026	187.673	0,19
200.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS*	5,85 %	21.06.2024	199.812	0,20
495.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS**	9,25 %	16.10.2028	525.593	0,54
500.000	YPF SA*	6,95 %	21.07.2027	447.886	0,46
490.000	YPF SA**	7,00 %	15.12.2047	370.664	0,38
112.500	YPF SA**	8,50 %	23.03.2025	109.634	0,11
285.000	YPF SA*	8,50 %	28.07.2025	275.479	0,28
138.462	YPF SA**	9,00 %	12.02.2026	140.879	0,14
	Unternehmensanleihen insgesamt			**83.464.415**	**85,35**
	Staatsanleihen 7,33 % (31. Dezember 2022: 4,48 %)				
	Euro				
6.298	Argentine Republic Government International Bond	0,50 %	09.07.2029	2.505	0,00
200.000	Bank Gospodarstwa Krajowego	5,13 %	22.02.2033	240.736	0,25
1.175.000	Ivory Coast Government International Bond	5,25 %	22.03.2030	1.168.311	1,20
215.000	Magyar Export-Import Bank Zrt	6,00 %	16.05.2029	252.603	0,26
1.375.000	Romanian Government International Bond	3,62 %	26.05.2030	1.400.058	1,43
137.000	Romanian Government International Bond	6,38 %	18.09.2033	160.344	0,16
	Euro insgesamt			**3.224.557**	**3,30**
	US-Dollar				
300.000	Airport Authority	3,25 %	12.01.2052	230.713	0,23
979.253	Argentine Republic Government International Bond	0,75 %	09.07.2030	395.135	0,40
452.025	Argentine Republic Government International Bond	3,50 %	09.07.2041	155.343	0,16
439.246	Argentine Republic Government International Bond	3,63 %	09.07.2035	151.788	0,15
415.685	Argentine Republic Government International Bond	4,25 %	09.01.2038	165.515	0,17
401.000	Chile Government International Bond	4,95 %	05.01.2036	397.260	0,41
200.000	Dominican Republic International Bond	5,50 %	22.02.2029	196.000	0,20
399.000	Dominican Republic International Bond	7,05 %	03.02.2031	419.947	0,43
279.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp	1,75 %	15.04.2026	257.811	0,26
200.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp	5,38 %	11.05.2028	202.197	0,21
284.000	Philippine Government International Bond	5,50 %	17.01.2048	300.237	0,31
400.000	Turkiye Government International Bond	5,95 %	15.01.2031	377.988	0,39
295.000	Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS	9,38 %	31.01.2026	309.187	0,32
156.000	Ukraine Government International Bond	7,75 %	01.09.2027	43.153	0,04
500.000	Ukraine Government International Bond	7,75 %	01.08.2041	225.553	0,23

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 7,33 % (31. Dezember 2022: 4,48 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
400.000	Ukraine Government International Bond	9,75 %	01.11.2030	116.000	0,12
	US-Dollar insgesamt			**3.943.827**	**4,03**
	Staatsanleihen insgesamt *			**7.168.384**	**7,33**
	Anlagen insgesamt			**90.632.799**	**92,68**

Devisenterminkontrakte 1,95 % (31. Dezember 2022: 0,87 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
2.910.933 US$	2.630.498 €	02.02.2024	Citibank NA	1	1.408	0,00
Abgesicherte Klassen CHF						
73.952 CHF	85.413 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	3.101	0,00
13.800.809 CHF	15.941.202 US$	14.03.2024	UBS AG	2	577.118	0,59
332.492 CHF	386.952 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	3	11.011	0,01
Abgesicherte Klassen EUR						
564.950 €	612.606 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	13.265	0,01
53.481.552 €	57.972.773 US$	14.03.2024	UBS AG	1	1.275.864	1,31
1.067.160 €	1.168.529 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	6	13.707	0,02
Abgesicherte Klassen GBP						
120 £	153 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	1	0,00
224.108 £	282.628 US$	14.03.2024	UBS AG	1	3.167	0,00
271 £	342 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	3	3	0,00
Abgesicherte Klassen SEK						
24.059 SEK	2.356 US$	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	38	0,00
2.140.552 SEK	205.011 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	4	7.992	0,01
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**1.906.675**	**1,95**

Futures-Kontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,05 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
10	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	27.031	0,03
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**27.031**	**0,03**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**92.566.505**	**94,66**

Sustainable Emerging Market Corporate Debt - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
2.630.498 €	2.907.516 US$	03.01.2024	Citibank NA	1	(1.736)	(0,00)
121.833 US$	865.136 CNY	20.03.2024	Citibank NA	2	(319)	(0,00)
2.878.281 US$	2.630.498 €	03.01.2024	HSBC Bank Plc	1	(27.498)	(0,03)
Abgesicherte Klassen EUR						
9.205.945 US$	8.493.267 €	14.03.2024	Goldman Sachs International	1	(203.177)	(0,21)
1.093 US$	1.000 €	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	(15)	(0,00)
Abgesicherte Klassen GBP						
269.861 US$	213.984 £	14.03.2024	UBS AG	1	(3.024)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SEK						
11.275 SEK	1.129 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	2	(7)	(0,00)
5.094 US$	53.001 SEK	14.03.2024	Westpac Banking Corp	4	(181)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(235.957)**	**(0,24)**

Futures-Kontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
(7)	Euro-Bund Future March 2024	(9.677)	(0,01)
(38)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	(156.156)	(0,16)
(7)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024	(70.328)	(0,07)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(236.161)**	**(0,24)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(472.118)**	**(0,48)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**92.094.387**	**94,18**
Sonstiges Nettovermögen	**5.694.750**	**5,82**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**97.789.137**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	59.605.545	60,53
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	31.027.254	31,51
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(209.130)	(0,21)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	1.670.718	1,70
Anlagen insgesamt		**92.094.387**	**93,53**

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 6,31 % (31. Dezember 2022: 4,87 %)				
	US-Dollar				
1.470.000	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC*	4,50 %	14.09.2027	1.446.561	0,32
799.000	Adib Sukuk Co II Ltd*	5,70 %	15.11.2028	821.948	0,18
1.419.000	Banco do Brasil SA**	6,25 %	18.04.2030	1.477.583	0,33
3.420.000	Banque Ouest Africaine de Developpement*	4,70 %	22.10.2031	2.922.698	0,66
1.274.000	Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais**	5,33 %	15.02.2028	1.255.311	0,28
560.000	Cemex SAB de CV**	5,13 %	29.12.2049	531.542	0,12
1.623.000	Cemex SAB de CV**	9,13 %	29.12.2049	1.730.304	0,39
913.000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank*	4,88 %	23.05.2024	903.386	0,20
1.521.000	Emirates NBD Bank PJSC*	5,88 %	11.10.2028	1.574.296	0,35
490.000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado*	3,07 %	18.08.2050	298.849	0,07
4.460.000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado*	3,83 %	14.09.2061	3.068.156	0,69
2.200.000	Gabon Blue Bond Master Trust Series 2†	6,10 %	01.08.2038	2.164.666	0,49
3.940.000	Inversiones CMPC SA**	3,00 %	06.04.2031	3.353.346	0,75
1.940.000	Suzano Austria GmbH*	5,00 %	15.01.2030	1.877.557	0,42
1.820.000	Suzano Austria GmbH**	7,00 %	16.03.2047	1.927.045	0,43
600.000	Telecomunicaciones Digitales SA**	4,50 %	30.01.2030	517.741	0,12
2.140.000	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO*	9,00 %	12.10.2028	2.249.440	0,51
	Unternehmensanleihen insgesamt			**28.120.429**	**6,31**
	Staatsanleihen 86,94 % (31. Dezember 2022: 85,91 %)				
	Euro				
1.281.234	Argentine Republic Government International Bond*	0,13 %	09.07.2030	512.554	0,12
2.560.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	0,50 %	08.07.2031	2.212.283	0,50
3.571.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	5,13 %	22.02.2033	4.298.340	0,96
5.635.000	Benin Government International Bond*	4,95 %	22.01.2035	4.921.406	1,10
1.600.000	Bulgaria Government International Bond*	4,13 %	23.09.2029	1.822.796	0,41
1.636.000	Bulgaria Government International Bond*	4,38 %	13.05.2031	1.901.643	0,43
2.180.000	Bulgaria Government International Bond*	4,50 %	27.01.2033	2.534.692	0,57
450.000	Bulgaria Government International Bond*	4,88 %	13.05.2036	533.132	0,12
11.600.022	Chile Government International Bond*	4,13 %	05.07.2034	13.117.014	2,94
3.300.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,25 %	22.03.2030	3.281.215	0,74
2.750.000	Ivory Coast Government International Bond*	5,88 %	17.10.2031	2.731.882	0,61
3.388.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,63 %	22.03.2048	2.994.043	0,67
7.485.000	Ivory Coast Government International Bond*	6,88 %	17.10.2040	6.942.896	1,56
2.795.000	Latvia Government International Bond*	0,25 %	23.01.2030	2.597.795	0,58
6.880.000	Mexico Government International Bond*	2,25 %	12.08.2036	5.992.191	1,34
4.050.000	Mexico Government International Bond*	3,38 %	23.02.2031	4.347.127	0,97
15.034.000	Peruvian Government International Bond*	1,25 %	11.03.2033	13.076.528	2,93
6.547.000	Peruvian Government International Bond*	1,95 %	17.11.2036	5.471.153	1,23

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 86,94 % (31. Dezember 2023: 85,91 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
4.685.000	Peruvian Government International Bond*	3,75 %	01.03.2030	5.152.100	1,16
3.670.000	Philippine Government International Bond*	0,70 %	03.02.2029	3.551.341	0,80
2.940.000	Philippine Government International Bond*	1,20 %	28.04.2033	2.615.112	0,59
6.708.000	Philippine Government International Bond*	1,75 %	28.04.2041	5.198.591	1,17
41.293	Provincia de Buenos Aires*	4,50 %	01.09.2037	15.837	0,00
696.000	Republic of Poland Government International Bond*	4,25 %	14.02.2043	812.808	0,18
2.966.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	28.01.2032	2.544.226	0,57
3.030.000	Romanian Government International Bond*	2,00 %	14.04.2033	2.514.551	0,56
2.202.000	Romanian Government International Bond*	2,12 %	16.07.2031	1.946.630	0,44
771.000	Romanian Government International Bond*	2,63 %	02.12.2040	574.702	0,13
755.000	Romanian Government International Bond*	2,88 %	13.04.2042	566.158	0,13
2.833.000	Romanian Government International Bond*	3,38 %	28.01.2050	2.143.689	0,48
6.785.000	Romanian Government International Bond*	3,62 %	26.05.2030	6.908.651	1,55
16.528.000	Romanian Government International Bond*	3,75 %	07.02.2034	15.787.650	3,54
3.560.000	Romanian Government International Bond*	3,88 %	29.10.2035	3.363.718	0,75
275.000	Romanian Government International Bond*	6,38 %	18.09.2033	321.858	0,07
11.738.000	Serbia International Bond*	1,50 %	26.06.2029	10.981.968	2,46
11.132.000	Serbia International Bond*	1,65 %	03.03.2033	9.121.420	2,05
4.652.000	Serbia International Bond*	2,05 %	23.09.2036	3.588.934	0,80
1.276.000	Ukraine Government International Bond**	6,75 %	20.06.2028	348.152	0,08
	Euro insgesamt			**157.346.786**	**35,29**
	US-Dollar				
17.900.785	Argentine Republic Government International Bond*	0,75 %	09.07.2030	7.223.087	1,62
216.342	Argentine Republic Government International Bond*	1,00 %	09.07.2029	86.969	0,02
38.659.307	Argentine Republic Government International Bond*	3,63 %	09.07.2035	13.359.310	3,00
2.346.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	5,38 %	22.05.2033	2.383.604	0,53
3.685.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	07.01.2041	3.415.465	0,77
6.145.000	Brazilian Government International Bond*	5,63 %	21.02.2047	5.417.537	1,21
8.846.000	Brazilian Government International Bond*	6,00 %	20.10.2033	8.865.419	1,99
2.400.000	Brazilian Government International Bond**	6,25 %	18.03.2031	2.493.843	0,56
1.090.000	Chile Government International Bond*	2,55 %	27.07.2033	904.512	0,20
5.700.000	Chile Government International Bond*	3,50 %	31.01.2034	5.095.298	1,14
200.000	Chile Government International Bond*	3,50 %	15.04.2053	151.119	0,03
489.000	Chile Government International Bond*	4,34 %	07.03.2042	438.433	0,10
1.454.000	Chile Government International Bond*	4,95 %	05.01.2036	1.440.441	0,32
4.623.000	Colombia Government International Bond*	3,00 %	30.01.2030	3.913.000	0,88

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 86,94 % (31. Dezember 2022: 85,91 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
3.777.000	Colombia Government International Bond*	3,88 %	25.04.2027	3.611.435	0,81
3.202.000	Colombia Government International Bond*	5,00 %	15.06.2045	2.495.527	0,56
4.576.000	Colombia Government International Bond*	5,20 %	15.05.2049	3.589.721	0,81
2.915.000	Colombia Government International Bond*	6,13 %	18.01.2041	2.659.179	0,60
14.534.000	Colombia Government International Bond*	7,50 %	02.02.2034	15.377.365	3,45
2.868.000	Colombia Government International Bond*	8,00 %	20.04.2033	3.133.362	0,70
890.000	Colombia Government International Bond**	8,00 %	14.11.2035	975.422	0,22
660.000	Colombia Government International Bond*	8,75 %	14.11.2053	760.488	0,17
1.290.000	Colombia Government International Bond*	10,38 %	28.01.2033	1.563.325	0,35
4.759.000	Costa Rica Government International Bond*	6,55 %	03.04.2034	4.940.437	1,10
5.993.000	Costa Rica Government International Bond*	7,16 %	12.03.2045	6.376.552	1,43
2.234.000	Costa Rica Government International Bond*	7,30 %	13.11.2054	2.429.475	0,54
3.900.000	Dominican Republic International Bond*	4,50 %	30.01.2030	3.602.820	0,81
5.483.000	Dominican Republic International Bond*	5,88 %	30.01.2060	4.756.228	1,07
2.210.000	Dominican Republic International Bond*	5,95 %	25.01.2027	2.222.818	0,50
8.741.000	Dominican Republic International Bond*	6,00 %	22.02.2033	8.642.664	1,94
6.282.000	Dominican Republic International Bond*	6,40 %	05.06.2049	5.928.638	1,33
460.000	Dominican Republic International Bond*	7,05 %	03.02.2031	484.150	0,11
7.281.000	El Salvador Government International Bond*	7,65 %	15.06.2035	5.706.484	1,28
11.216.000	El Salvador Government International Bond*	9,50 %	15.07.2052	9.393.957	2,11
858.000	Fondo MIVIVIENDA SA*	4,63 %	12.04.2027	839.087	0,19
910.000	Ghana Government International Bond*	6,38 %	11.02.2027	408.636	0,09
4.468.000	Ghana Government International Bond*	7,75 %	07.04.2029	1.964.267	0,44
3.430.000	Ghana Government International Bond*	7,88 %	26.03.2027	1.541.137	0,35
968.000	Ghana Government International Bond*	8,95 %	26.03.2051	420.538	0,09
9.663.000	Ghana Government International Bond*	10,75 %	14.10.2030	6.117.896	1,37
1.560.000	Istanbul Metropolitan Municipality*	10,50 %	06.12.2028	1.659.450	0,37
1.809.121	Ivory Coast Government International Bond*	5,75 %	31.12.2032	1.714.052	0,38
1.593.000	Jordan Government International Bond*	7,38 %	10.10.2047	1.420.328	0,32
11.478.000	Mexico Government International Bond*	5,75 %	12.10.2110	10.314.998	2,31
1.360.000	Mongolia Government International Bond*	7,88 %	05.06.2029	1.392.629	0,31
9.929.000	Morocco Government International Bond*	3,00 %	15.12.2032	8.192.458	1,84
10.126.000	Morocco Government International Bond*	6,50 %	08.09.2033	10.704.225	2,40
1.373.000	Peruvian Government International Bond*	3,00 %	15.01.2034	1.163.178	0,26
202.231	Provincia de Mendoza Argentina*	5,75 %	19.03.2029	173.413	0,04
4.961.000	Republic of Armenia International Bond*	3,60 %	02.02.2031	4.068.903	0,91
10.260.000	Republic of Armenia International Bond*	3,95 %	26.09.2029	8.971.036	2,01
750.000	Republic of Poland Government International Bond*	5,50 %	04.04.2053	783.972	0,18

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Staatsanleihen 86,94 % (31. Dezember 2022: 85,91 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
1.548.000	Republic of Poland Government International Bond*	5,75 %	16.11.2032	1.674.766	0,38
800.000	Republic of Uzbekistan International Bond*	3,70 %	25.11.2030	674.440	0,15
982.000	Republic of Uzbekistan International Bond*	5,38 %	20.02.2029	932.447	0,21
3.254.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,20 %	11.05.2027	1.652.390	0,37
3.089.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,75 %	18.04.2028	1.561.670	0,35
7.800.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,83 %	18.07.2026	4.012.291	0,90
2.078.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	14.03.2024	1.058.171	0,24
5.337.000	Sri Lanka Government International Bond*	6,85 %	03.11.2025	2.761.886	0,62
1.512.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,55 %	28.03.2030	763.365	0,17
2.655.000	Sri Lanka Government International Bond*	7,85 %	14.03.2029	1.340.982	0,30
290.000	Tunisian Republic*	5,75 %	30.01.2025	238.684	0,05
4.357.000	Ukraine Government International Bond*	6,88 %	21.05.2031	1.016.052	0,23
1.873.000	Ukraine Government International Bond*	7,38 %	25.09.2034	444.931	0,10
1.470.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2027	406.631	0,09
1.865.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.09.2029	517.178	0,12
5.729.000	Ukraine Government International Bond*	7,75 %	01.08.2041	2.584.392	0,58
10.367.000	Ukraine Government International Bond*	9,75 %	01.11.2030	3.006.430	0,67
	US-Dollar insgesamt			**230.334.993**	**51,65**
	Staatsanleihen insgesamt			**387.681.779**	**86,94**
	Anlagen insgesamt			**415.802.208**	**93,25**

Devisenterminkontrakte 1,97 % (31. Dezember 2022: 0,78 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
5.288.142 €	5.765.214 US$	03.01.2024	Citibank NA	2	76.332	0,02
162.976.008 US$	147.309.589 €	02.02.2024	Citibank NA	1	40.766	0,01
Abgesicherte Klassen EUR						
346.171.936 €	375.133.372 US$	14.03.2024	Standard Chartered Bank	1	8.367.376	1,88
4.929.135 €	5.344.209 US$	14.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	116.450	0,02
13.095.613 €	14.327.467 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	7	180.289	0,04
16.772 US$	15.060 €	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	88	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**8.781.301**	**1,97**

Futures-Kontrakte 1,70 % (31. Dezember 2022: 1,59 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
7	Euro-Schatz Future March 2024	3.518	0,00
62	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	254.297	0,06

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 1,70 % (31. Dezember 2022: 1,59 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettovermögens
148	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024	334.156	0,07
680	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	1.755.438	0,39
275	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024	2.316.828	0,52
242	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	2.926.750	0,66
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**7.590.987**	**1,70**

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**432.174.496**	**96,92**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,46 %) (31. Dezember 2022: (0,54 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
147.309.589 €	162.784.461 US$	03.01.2024	Citibank NA	1	(58.904)	(0,01)
2.406.387 US$	2.205.037 €	03.01.2024	Citibank NA	1	(29.407)	(0,01)
159.526.156 US$	145.770.694 €	03.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(1.499.461)	(0,33)
5.076.021 US$	4.622.000 €	03.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(29.672)	(0,01)
Abgesicherte Klassen EUR						
2.105.047 €	2.337.627 US$	14.03.2024	Westpac Banking Corp	1	(5.587)	(0,00)
26.343.993 US$	24.166.119 €	14.03.2024	Westpac Banking Corp	12	(428.035)	(0,10)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(2.051.066)**	**(0,46)**

Futures-Kontrakte (0,82 %) (31. Dezember 2022: (0,03 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
(58)	Euro-BOBL Future March 2024	(92.470)	(0,02)
(677)	Euro-Bund Future March 2024	(2.450.776)	(0,55)
(125)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024	(1.112.383)	(0,25)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(3.655.629)**	**(0,82)**

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(5.706.695)**	**(1,28)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**426.467.801**	**95,64**
Sonstiges Nettovermögen	**19.424.469**	**4,36**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**445.892.270**	**100,00**

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

	Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	399.027.253	88,31
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	14.610.289	3,23
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	2.164.666	0,48
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	3.935.358	0,87
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	6.730.235	1,49
Anlagen insgesamt		**426.467.801**	**94,38**

Tactical Macro – Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Schatzwechsel 84,66 %				
	US-Dollar				
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	16.01.2024	4.989.787	18,37
6.805.800	United States Treasury Bill	0,00 %	30.01.2024	6.777.809	24,96
5.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	06.02.2024	4.974.360	18,31
5.200.000	United States Treasury Bill	0,00 %	15.02.2024	5.166.722	19,02
547.700	United States Treasury Bill	0,00 %	05.03.2024	542.723	2,00
548.800	United States Treasury Bill	0,00 %	19.03.2024	542.702	2,00
	Schatzwechsel insgesamt **			**22.994.103**	**84,66**
	Anlagen insgesamt			**22.994.103**	**84,66**

Devisenterminkontrakte 0,25 %

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
1.980.280 AUD	1.341.145 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	10.803	0,04
2.495.300 €	2.151.173 £	11.01.2024	Goldman Sachs International	1	14.858	0,05
179.927.607 ¥	990.300 £	11.01.2024	Goldman Sachs International	1	15.391	0,06
193.091.294 ¥	1.346.660 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	26.279	0,10
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**67.331**	**0,25**

Futures-Kontrakte 0,03 %

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
4	TOPIX Index Future March 2024	8.973	0,03
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**8.973**	**0,03**

Gekaufte Optionskontrakte 1,32 %

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fällig-keit	Art	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Kaufoptionen				
62	13.12.2024	3 Month SOFR Future, Strike Price $96.50 ±	67.038	0,25
91	13.09.2024	3 Month SOFR Future, Strike Price $95.50 ±	142.756	0,52
1.627.000 USD	24.01.2024	United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price 147.50 ∞	587	0,00
Verkaufsoptionen				
34	21.06.2024	E-mini Russell 2000 Index Future, Strike Price $1,800.00 ±	57.290	0,21
5	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,800.00 ±	10.425	0,04

Tactical Macro – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 1,32 % (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
1.627.000 USD	24.01.2024	United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price 147.50 ∞	81.203	0,30
Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: (331.192) US$)			**359.299**	**1,32**

Die Gegenpartei für alle OTC-Optionskontrakte ist Goldman Sachs International.

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**23.429.706**	**86,26**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,14 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
1.074.188 £	1.247.650 €	11.01.2024	Goldman Sachs International	1	(9.213)	(0,03)
514.960 £	94.350.353 ¥	11.01.2024	Goldman Sachs International	1	(13.594)	(0,05)
673.330 US$	96.667.294 ¥	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(14.004)	(0,06)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(36.811)**	**(0,14)**

Futures Kontrakte (0,10 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
(2)	Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future March 2024	(28.337)	(0,10)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(28.337)**	**(0,10)**

Verkaufte Optionskontrakte (0,73 %)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufoptionen				
62	13.12.2024	3 Month SOFR Future, Strike Price $97.50 ±	(26.738)	(0,10)
91	13.09.2024	3 Month SOFR Future, Strike Price $96.00 ±	(88.725)	(0,33)
(1.627.000) USD	24.01.2024	United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price 147.50 ∞	(587)	(0,00)
Verkaufsoptionen				
(1.627.000) USD	24.01.2024	United States Dollar/Japanese Yen Currency Option, Strike Price 147.50 ∞	(81.203)	(0,30)
Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt (Prämie: 142.462 US$)			**(197.253)**	**(0,73)**

Die Gegenpartei für alle OTC-Optionskontrakte ist Goldman Sachs International.

Tactical Macro – Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(262.401)**	**(0,97)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**23.167.305**	**85,29**
Sonstiges Nettovermögen	**3.995.003**	**14,71**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**27.162.308**	**100,00**

	Portfolioanalyse	US$	% des Gesamtver-mögens
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	22.994.103	83,56
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	142.682	0,52
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	30.520	0,11
Anlagen insgesamt		**23.167.305**	**84,19**

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Netto-vermögens
	Schatzwechsel 0,90 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
	Euro				
9.000.000	Finland T-Bill	0,00 %	13.02.2024	8.960.964	0,90
	Schatzwechsel insgesamt **			**8.960.964**	**0,90**
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) 9,14 % (31. Dezember 2022: 8,81 %)				
	Euro				
5.933.234	Clavel Residential 3 DAC Series 2023-1X Class A	5,35 %	28.01.2076	5.903.129	0,59
818.750	Domi BV Series 2020-1 Class A	4,77 %	15.04.2052	820.439	0,08
1.500.000	Domi BV Series 2020-2 Class B	5,50 %	15.11.2052	1.494.394	0,15
12.329.175	Dutch Property Finance BV Series 2021-2 Class A	4,65 %	28.04.2059	12.290.298	1,24
1.940.185	Dutch Property Finance BV Series 2022-2 Class A	4,85 %	28.04.2062	1.939.752	0,20
826.405	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC Class A	6,88 %	24.02.2058	820.837	0,08
2.110.702	Futura S.r.l. Series 2019-1 Class A	6,97 %	31.07.2044	2.103.235	0,21
191.515	Gedesco Trade Receivables Designated Activity Co Series 2020-1 Class A	5,03 %	24.01.2026	183.309	0,02
3.199.143	Jubilee Place Retail Unit Trust LP Series 3 Class A	4,84 %	17.01.2059	3.202.295	0,32
6.178.334	Merrion Square Residential Series 2023-1 DAC Class A	4,88 %	24.10.2064	6.141.802	0,62
9.819.719	MIRAVET Sarl Series 2019-1 Class A	4,71 %	26.05.2065	9.706.390	0,98
3.225.976	MIRAVET Sarl Series 2020-1 Class A	4,81 %	26.05.2065	3.206.694	0,32
5.156.990	Mulcair Securities No. 3 DAC Series 3 Class A	4,92 %	24.04.2065	5.130.998	0,52
350.544	Primrose Residental 2021-1 DAC Series 2021-1 Class A	4,63 %	24.03.2061	350.756	0,04
1.500.000	Primrose Residental Series 2021-1 Class B	5,23 %	24.03.2061	1.487.470	0,15
5.317.715	Primrose Residential Series 2022-1 Class A	4,88 %	24.10.2061	5.304.963	0,53
3.500.000	Primrose Residential Series 2022-1 Class D	6,28 %	24.10.2061	3.251.335	0,33
7.000.000	Quarzo Series 2023-1 Class A1	4,88 %	15.12.2039	7.020.398	0,71
4.338.180	Red & Black Auto Italy SRL Series 2 Class A1	4,87 %	28.07.2034	4.356.639	0,44
2.900.000	RED & Black Auto Lease France Series 2 Class A	4,56 %	27.06.2035	2.905.011	0,29
186.495	Retiro Mortgage Securities Series 1X Class A1	5,00 %	30.07.2075	185.862	0,02
1.300.000	Shamrock Residential DAC Series 2022-1 Class C	5,78 %	24.01.2061	1.270.859	0,13
2.500.000	Shamrock Residential DAC Series 2023-1X Class C	6,63 %	24.06.2071	2.429.248	0,24
4.900.000	Stresa Securitisation SRL Series 1 Class A	5,17 %	22.12.2045	4.750.643	0,48
712.722	Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 2019 Class A1	5,82 %	12.05.2025	716.763	0,07
2.627.303	Tagus - Sociedade de Titularizacao de Creditos SA Series 3 Class C	7,55 %	23.06.2039	2.650.668	0,27
1.101.297	Warrington Residential 2022-1 DAC Series 2022-1 Class A1	5,88 %	24.12.2056	1.062.973	0,11
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) insgesamt **			**90.687.160**	**9,14**
	Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %)				
	Euro				
2.000.000	AbbVie Inc*	1,25 %	01.06.2024	1.978.160	0,20
100.000	ABN AMRO Bank NV*	3,75 %	20.04.2025	100.408	0,01
200.000	Accor SA*	2,63 %	29.12.2049	195.453	0,02

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
23.000.000	Aegon Bank NV*	0,38 %	21.11.2024	22.366.787	2,25
100.000	Afflelou SAS*	4,25 %	19.05.2026	99.875	0,01
2.000.000	ALD SA*	1,25 %	02.03.2026	1.910.618	0,19
2.600.000	Allianz SE*	2,60 %	29.12.2049	1.893.658	0,19
200.000	Allwyn International AS**	3,88 %	15.02.2027	193.000	0,02
1.000.000	Altice France SA*	3,38 %	15.01.2028	796.379	0,08
1.000.000	Altice France SA**	4,13 %	15.01.2029	802.220	0,08
9.000.000	AMCO - Asset Management Co SpA**	1,38 %	27.01.2025	8.765.730	0,88
1.090.000	AMCO - Asset Management Co SpA*	4,63 %	06.02.2027	1.120.161	0,11
3.600.000	American Tower Corp*	0,40 %	15.02.2027	3.283.546	0,33
2.000.000	American Tower Corp*	0,45 %	15.01.2027	1.831.074	0,18
700.000	American Tower Corp*	1,95 %	22.05.2026	675.690	0,07
800.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd*	3,95 %	17.07.2026	819.093	0,08
400.000	APA Infrastructure Ltd*	7,13 %	09.11.2083	421.046	0,04
200.000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance Plc*	2,00 %	01.09.2028	178.051	0,02
100.000	Arena Luxembourg Finance Sarl*	1,88 %	01.02.2028	89.669	0,01
2.000.000	Arkema SA*	1,50 %	29.12.2049	1.858.150	0,19
5.000.000	Arkema SA*	2,75 %	29.12.2049	4.955.750	0,50
5.000.000	Aroundtown SA*	0,38 %	15.04.2027	4.034.750	0,41
4.100.000	Aroundtown SA*	1,63 %	31.01.2028	3.335.095	0,34
400.000	Aroundtown SA*	2,13 %	29.12.2049	147.135	0,01
4.900.000	Aroundtown SA*	3,38 %	29.12.2049	2.065.458	0,21
4.000.000	Arval Service Lease SA*	0,00 %	01.10.2025	3.766.584	0,38
8.000.000	Arval Service Lease SA*	3,38 %	04.01.2026	7.998.688	0,81
1.800.000	Arval Service Lease SA*	4,13 %	13.04.2026	1.822.883	0,18
1.700.000	Arval Service Lease SA*	4,25 %	11.11.2025	1.720.830	0,17
2.900.000	Arval Service Lease SA*	4,63 %	02.12.2024	2.915.480	0,29
500.000	Ashland Services BV**	2,00 %	30.01.2028	465.933	0,05
100.000	Assemblin Group AB**	8,96 %	05.07.2029	101.738	0,01
100.000	AT&T Inc*	3,55 %	18.11.2025	100.599	0,01
10.900.000	Athene Global Funding*	0,37 %	10.09.2026	9.994.002	1,01
9.000.000	Athene Global Funding*	0,83 %	08.01.2027	8.312.535	0,84
5.000.000	Athene Global Funding*	1,24 %	08.04.2024	4.958.018	0,50
2.400.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd*	1,63 %	11.03.2081	2.171.480	0,22
11.900.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd*	3,44 %	04.04.2025	11.915.340	1,20
8.400.000	Autostrade per l'Italia SpA*	2,00 %	04.12.2028	7.734.056	0,78
2.400.000	Balder Finland OYJ*	1,00 %	18.01.2027	2.036.606	0,21
2.000.000	Banco BPM SpA*	3,88 %	18.09.2026	2.037.566	0,21
200.000	Banco BPM SpA*	6,00 %	14.06.2028	209.614	0,02

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
1.000.000	Banco de Credito Social Cooperativo SA*	7,50 %	14.09.2029	1.050.924	0,11
500.000	Banco de Sabadell SA*	2,63 %	24.03.2026	490.384	0,05
10.200.000	Banco Santander SA*	0,10 %	26.01.2025	10.174.000	1,02
100.000	Banco Santander SA*	3,75 %	16.01.2026	100.890	0,01
1.200.000	Banijay Entertainment SASU**	7,00 %	01.05.2029	1.269.050	0,13
2.000.000	Bank of America Corp*	1,78 %	04.05.2027	1.922.112	0,19
15.000.000	Bank of Nova Scotia*	3,05 %	31.10.2024	14.938.230	1,50
4.700.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	0,01 %	07.03.2025	4.504.546	0,45
500.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	0,01 %	11.05.2026	464.942	0,05
11.800.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	2,78 %	29.12.2049	9.888.400	1,00
6.510.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA*	3,21 %	29.12.2049	5.476.212	0,55
5.000.000	Barclays Plc*	0,75 %	09.06.2025	4.924.555	0,50
7.000.000	Barclays Plc*	2,89 %	31.01.2027	6.887.302	0,69
2.000.000	Bayer AG*	6,63 %	25.09.2083	2.043.260	0,21
200.000	Bayer Capital Corp BV*	1,50 %	26.06.2026	190.686	0,02
2.500.000	Bayerische Landesbank*	7,00 %	05.01.2034	2.594.160	0,26
1.850.000	BCP V Modular Services Finance II Plc**	4,75 %	30.11.2028	1.723.499	0,17
7.000.000	BNP Paribas SA*	0,25 %	13.04.2027	6.500.620	0,65
200.000	BPCE SA*	0,38 %	02.02.2026	188.625	0,02
6.000.000	BPCE SA*	0,63 %	28.04.2025	5.779.566	0,58
9.000.000	BPCE SFH SA*	0,13 %	31.03.2025	8.657.820	0,87
1.300.000	CA Auto Bank SpA*	0,00 %	16.04.2024	1.286.082	0,13
2.300.000	CA Auto Bank SPA*	4,75 %	25.01.2027	2.378.379	0,24
100.000	Caixa Central de Credito Agricola Mutuo CRL*	8,38 %	04.07.2027	104.086	0,01
5.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce*	0,38 %	10.03.2026	4.721.800	0,48
5.500.000	Capital One Financial Corp*	0,80 %	12.06.2024	5.413.391	0,55
4.400.000	Carrier Global Corp*	4,38 %	29.05.2025	4.439.666	0,45
200.000	Celanese US Holdings LLC*	2,13 %	01.03.2027	191.333	0,02
100.000	Cellnex Telecom SA*	1,75 %	23.10.2030	87.862	0,01
800.000	Cirsa Finance International Sarl*	4,50 %	15.03.2027	772.248	0,08
100.000	Cirsa Finance International Sarl*	7,88 %	31.07.2028	104.645	0,01
8.000.000	Citigroup Inc*	1,25 %	06.07.2026	7.705.264	0,78
5.700.000	Citigroup Inc*	1,50 %	24.07.2026	5.505.283	0,55
4.000.000	CK Hutchison Finance 16 II Ltd*	0,88 %	03.10.2024	3.898.836	0,39
200.000	Commerzbank AG*	0,10 %	11.09.2025	189.660	0,02
2.200.000	Commerzbank AG*	6,75 %	05.10.2033	2.347.400	0,24
900.000	CPI Property Group SA*	1,63 %	23.04.2027	663.420	0,07
1.500.000	CPI Property Group SA*	2,75 %	12.05.2026	1.256.020	0,13
6.000.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA*	0,13 %	16.12.2024	5.818.515	0,59
11.000.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA*	0,38 %	30.09.2024	10.747.836	1,08

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
14.000.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA*	0,63 %	10.02.2025	13.585.880	1,37
6.600.000	Credit Suisse AG*	0,25 %	05.01.2026	6.197.684	0,62
2.000.000	Credit Suisse AG*	1,50 %	10.04.2026	1.916.375	0,19
2.000.000	Credit Suisse AG*	2,13 %	31.05.2024	1.983.980	0,20
2.400.000	Cullinan Holdco Scsp**	4,63 %	15.10.2026	1.876.080	0,19
700.000	Deutsche Bank AG*	1,00 %	19.11.2025	680.966	0,07
200.000	Deutsche Lufthansa AG*	3,50 %	14.07.2029	195.226	0,02
3.000.000	Deutsche Postbank Funding Trust III*	3,13 %	29.12.2049	2.282.250	0,23
4.000.000	Digital Euro Finco LLC*	2,50 %	16.01.2026	3.898.472	0,39
4.906.000	Digital Euro Finco LLC*	2,63 %	15.04.2024	4.878.296	0,49
1.300.000	doValue SpA*	3,38 %	31.07.2026	1.175.372	0,12
500.000	doValue SpA**	5,00 %	04.08.2025	489.920	0,05
100.000	Dufry One BV*	3,38 %	15.04.2028	95.637	0,01
3.000.000	easyJet FinCo BV*	1,88 %	03.03.2028	2.808.095	0,28
1.200.000	Electricite de France SA*	2,88 %	29.12.2049	1.115.519	0,11
1.600.000	Electricite de France SA*	3,75 %	05.06.2027	1.632.418	0,16
1.500.000	Electricite de France SA*	4,00 %	29.12.2049	1.490.911	0,15
1.000.000	Emeria SASU**	3,38 %	31.03.2028	861.550	0,09
200.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,38 %	31.08.2081	171.167	0,02
1.000.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	1,88 %	29.06.2080	935.870	0,09
2.500.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG*	2,13 %	31.08.2081	1.955.770	0,20
200.000	Enel Finance International NV*	0,00 %	28.05.2026	185.667	0,02
1.500.000	Enel SpA*	1,38 %	29.12.2049	1.314.300	0,13
1.000.000	Energia Group Roi Financeco DAC**	6,88 %	31.07.2028	1.040.900	0,10
1.000.000	Energizer Gamma Acquisition BV**	3,50 %	30.06.2029	865.320	0,09
2.500.000	Engie SA*	1,88 %	29.12.2049	2.078.932	0,21
2.000.000	Eni SpA*	3,38 %	29.12.2049	1.840.054	0,19
500.000	Evonik Industries AG*	1,38 %	02.09.2081	444.577	0,04
2.800.000	Fastighets AB Balder*	1,13 %	29.01.2027	2.401.330	0,24
6.700.000	Fastighets AB Balder*	1,88 %	23.01.2026	6.120.559	0,62
23.000.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec*	2,88 %	28.11.2024	22.858.182	2,30
100.000	Forvia SE*	2,63 %	15.06.2025	98.341	0,01
100.000	Forvia SE*	2,75 %	15.02.2027	95.974	0,01
500.000	Global Payments Inc*	4,88 %	17.03.2031	526.197	0,05
200.000	Goldman Sachs Group Inc*	1,38 %	15.05.2024	198.121	0,02
4.800.000	Grand City Properties SA*	1,50 %	29.12.2049	2.207.904	0,22
500.000	Grand City Properties SA*	5,90 %	29.12.2049	286.809	0,03
2.000.000	Grifols SA*	1,63 %	15.02.2025	1.960.912	0,20
200.000	Gruenenthal GmbH*	3,63 %	15.11.2026	197.900	0,02
1.000.000	Grupo Antolin-Irausa SA*	3,50 %	30.04.2028	764.365	0,08

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
100.000	Haleon Netherlands Capital BV*	1,25 %	29.03.2026	96.011	0,01
100.000	Heathrow Funding Ltd*	1,50 %	12.10.2025	96.885	0,01
6.435.000	Heimstaden Bostad AB*	1,13 %	21.01.2026	5.522.189	0,56
6.800.000	Heimstaden Bostad AB*	3,38 %	29.12.2049	2.887.552	0,29
3.600.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	0,25 %	13.10.2024	3.396.856	0,34
5.300.000	Heimstaden Bostad Treasury BV*	0,63 %	24.07.2025	4.711.016	0,47
8.500.000	Holcim Finance Luxembourg SA*	1,50 %	06.04.2025	8.282.471	0,83
2.000.000	Holcim Finance Luxembourg SA*	3,00 %	29.12.2049	1.986.684	0,20
8.000.000	HSBC Holdings Plc*	0,31 %	13.11.2026	7.543.416	0,76
2.500.000	Iberdrola Finanzas SA*	1,58 %	29.12.2049	2.231.325	0,22
1.750.000	Iceland Bondco Plc**	9,50 %	15.12.2027	1.753.500	0,18
200.000	IHO Verwaltungs GmbH*	8,75 %	15.05.2028	218.368	0,02
600.000	Iliad Holding SASU**	5,13 %	15.10.2026	599.948	0,06
200.000	INEOS Finance Plc*	2,88 %	01.05.2026	194.291	0,02
6.500.000	ING Groep NV*	0,13 %	29.11.2025	6.278.980	0,63
15.000.000	Intesa Sanpaolo SpA**	2,13 %	26.05.2025	14.707.800	1,48
1.500.000	Intesa Sanpaolo SpA*	2,93 %	14.10.2030	1.371.435	0,14
5.500.000	Intesa Sanpaolo SpA**	5,00 %	08.03.2028	5.696.037	0,57
6.100.000	Investec Bank Plc*	1,25 %	11.08.2026	5.730.377	0,58
8.376.000	Islandsbanki HF*	0,75 %	25.03.2025	7.982.345	0,80
10.026.000	Islandsbanki HF*	7,38 %	17.05.2026	10.564.216	1,06
650.000	Italmatch Chemicals SpA*	10,00 %	06.02.2028	673.517	0,07
100.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc*	4,50 %	15.07.2028	97.957	0,01
3.600.000	KBC Group NV*	4,50 %	06.06.2026	3.640.507	0,37
1.000.000	Kleopatra Finco Sarl**	4,25 %	01.03.2026	829.038	0,08
4.500.000	Landsbankinn HF*	0,38 %	23.05.2025	4.227.466	0,43
14.000.000	Landsbankinn HF*	0,75 %	25.05.2026	12.750.220	1,28
3.040.000	Landsbankinn HF*	6,38 %	12.03.2027	3.152.638	0,32
3.000.000	LeasePlan Corp NV*	0,25 %	23.02.2026	2.796.849	0,28
1.700.000	LeasePlan Corp NV*	0,25 %	07.09.2026	1.563.344	0,16
2.200.000	Leasys SpA*	4,38 %	07.12.2024	2.204.868	0,22
5.000.000	Lloyds Bank Plc*	3,25 %	02.02.2026	5.024.445	0,51
6.000.000	Lloyds Banking Group Plc*	0,50 %	12.11.2025	5.828.982	0,59
6.000.000	Lloyds Banking Group Plc*	3,50 %	01.04.2026	5.984.172	0,60
600.000	Lorca Telecom Bondco SA*	4,00 %	18.09.2027	587.247	0,06
200.000	Loxam SAS*	4,50 %	15.04.2027	190.736	0,02
800.000	Loxam SAS*	6,38 %	15.05.2028	835.120	0,08
2.200.000	Loxam SAS*	6,38 %	31.05.2029	2.284.634	0,23
380.000	Maxeda DIY Holding BV**	5,88 %	01.10.2026	290.559	0,03
2.200.000	Merck KGaA*	1,63 %	25.06.2079	2.146.084	0,22

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
3.700.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc*	3,27 %	19.09.2025	3.677.878	0,37
200.000	MMS USA Holdings Inc*	0,63 %	13.06.2025	191.788	0,02
5.000.000	Molson Coors Beverage Co*	1,25 %	15.07.2024	4.925.820	0,50
7.000.000	Morgan Stanley*	1,88 %	27.04.2027	6.684.048	0,67
3.000.000	Mylan Inc*	2,13 %	23.05.2025	2.929.866	0,29
1.200.000	Nationwide Building Society*	3,25 %	05.09.2029	1.199.688	0,12
15.000.000	NatWest Group Plc*	1,75 %	02.03.2026	14.610.420	1,47
2.000.000	NGG Finance Plc*	1,63 %	05.12.2079	1.960.000	0,20
1.500.000	Nordea Bank Abp*	1,00 %	27.06.2029	1.469.233	0,15
5.000.000	OMV AG*	2,88 %	29.12.2049	4.980.535	0,50
150.000	Ontex Group NV*	3,50 %	15.07.2026	145.088	0,01
2.000.000	Orano SA*	3,38 %	23.04.2026	1.984.922	0,20
1.500.000	Orsted AS*	2,25 %	29.12.2049	1.468.155	0,15
200.000	Paprec Holding SA**	6,50 %	17.11.2027	214.221	0,02
500.000	PCF GmbH*	4,75 %	15.04.2026	366.836	0,04
100.000	PEU Finance Plc*	7,25 %	01.07.2028	103.185	0,01
2.000.000	Pinnacle Bidco Plc*	8,25 %	11.10.2028	2.085.074	0,21
1.300.000	Playtech Plc*	4,25 %	07.03.2026	1.276.462	0,13
100.000	PLT VII Finance Sarl**	4,63 %	05.01.2026	99.690	0,01
4.100.000	Prosus NV*	2,78 %	19.01.2034	3.206.688	0,33
1.800.000	RCI Banque SA*	1,63 %	11.04.2025	1.757.516	0,18
1.500.000	RCI Banque SA*	1,75 %	10.04.2026	1.442.214	0,15
200.000	RCI Banque SA*	2,00 %	11.07.2024	197.917	0,02
1.700.000	RCI Banque SA*	4,63 %	13.07.2026	1.739.612	0,18
2.100.000	RCI Banque SA*	4,63 %	02.10.2026	2.155.492	0,22
3.000.000	Repsol International Finance BV*	2,50 %	29.12.2049	2.813.914	0,28
200.000	Rexel SA*	5,25 %	15.09.2030	208.966	0,02
200.000	Ryanair DAC*	0,88 %	25.05.2026	189.041	0,02
3.380.000	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB*	2,63 %	29.12.2049	562.432	0,06
5.000.000	Santander UK Group Holdings Plc*	0,39 %	28.02.2025	4.971.344	0,50
500.000	Sappi Papier Holding GmbH*	3,63 %	15.03.2028	481.355	0,05
1.900.000	SELP Finance Sarl*	3,75 %	10.08.2027	1.903.718	0,19
1.000.000	Simon International Finance SCA*	1,25 %	13.05.2025	965.884	0,10
5.000.000	Skipton Building Society*	0,01 %	22.09.2024	4.867.510	0,49
5.000.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC*	2,88 %	15.01.2026	4.932.499	0,50
100.000	Societe Generale SA*	1,25 %	15.02.2024	99.670	0,01
100.000	SoftBank Group Corp*	2,13 %	06.07.2024	98.530	0,01
1.800.000	SoftBank Group Corp*	5,00 %	15.04.2028	1.790.874	0,18
2.400.000	Sogecap SA*	6,50 %	16.05.2044	2.596.243	0,26
4.640.000	Southern Co*	1,88 %	15.09.2081	3.991.014	0,40

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
2.500.000	SSE Plc*	4,00 %	29.12.2049	2.428.862	0,24
15.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp*	3,60 %	16.02.2026	15.094.079	1,52
2.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd*	4,09 %	19.04.2028	2.073.690	0,21
262.000	Summit Properties Ltd*	2,00 %	31.01.2025	246.968	0,02
4.900.000	Swedbank AB*	4,63 %	30.05.2026	4.953.288	0,50
3.000.000	Tapestry Inc*	5,35 %	27.11.2025	3.062.910	0,31
2.100.000	TDC Net A/S*	5,62 %	06.02.2030	2.170.873	0,22
1.000.000	Telecom Italia SpA*	6,88 %	15.02.2028	1.067.542	0,11
1.500.000	Telefonica Europe BV*	2,38 %	29.12.2049	1.306.836	0,13
1.600.000	Telefonica Europe BV*	6,75 %	29.12.2049	1.712.379	0,17
200.000	Tereos Finance Groupe I SA**	4,75 %	30.04.2027	202.087	0,02
1.800.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV*	1,63 %	15.10.2028	1.539.065	0,15
6.500.000	Thames Water Utilities Finance Plc*	0,88 %	31.01.2028	5.559.958	0,56
4.400.000	Thames Water Utilities Finance Plc*	4,00 %	18.04.2027	4.259.249	0,43
3.000.000	Toronto-Dominion Bank*	1,71 %	28.07.2025	2.934.225	0,30
2.000.000	Toronto-Dominion Bank*	2,55 %	03.08.2027	1.958.772	0,20
700.000	Toronto-Dominion Bank*	3,77 %	08.09.2026	714.497	0,07
3.800.000	TotalEnergies SE*	2,13 %	29.12.2049	3.049.986	0,31
11.400.000	Traton Finance Luxembourg SA*	4,13 %	18.01.2025	11.442.944	1,15
2.800.000	Traton Finance Luxembourg SA*	4,50 %	23.11.2026	2.862.059	0,29
9.000.000	UBS Group AG*	0,25 %	29.01.2026	8.629.047	0,87
8.300.000	UBS Group AG*	1,25 %	17.07.2025	8.162.336	0,82
5.500.000	UBS Group AG*	2,13 %	13.10.2026	5.348.173	0,54
700.000	UBS Group AG*	3,25 %	02.04.2026	693.978	0,07
2.700.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE*	7,25 %	29.12.2049	2.709.842	0,27
6.000.000	UniCredit SpA**	1,20 %	20.01.2026	5.825.976	0,59
5.000.000	UniCredit SpA*	1,25 %	16.06.2026	4.828.460	0,49
5.896.000	UniCredit SpA**	2,20 %	22.07.2027	5.699.273	0,57
2.200.000	UniCredit SpA**	5,85 %	15.11.2027	2.332.161	0,23
200.000	United Group BV**	5,25 %	01.02.2030	190.106	0,02
8.300.000	US Bancorp*	0,85 %	07.06.2024	8.179.608	0,82
11.000.000	Utah Acquisition Sub Inc*	2,25 %	22.11.2024	10.813.429	1,09
2.900.000	Veolia Environnement SA*	2,50 %	29.12.2049	2.602.944	0,26
100.000	Verisure Holding AB*	7,13 %	01.02.2028	105.497	0,01
1.600.000	Virgin Money UK Plc*	2,88 %	24.06.2025	1.590.259	0,16
2.600.000	Vodafone Group Plc*	3,00 %	27.08.2080	2.333.256	0,23
4.800.000	Volkswagen Bank GmbH*	2,50 %	31.07.2026	4.680.863	0,47
1.500.000	Volkswagen International Finance NV*	3,75 %	29.12.2049	1.410.305	0,14
1.600.000	Volkswagen International Finance NV*	3,88 %	29.03.2026	1.612.791	0,16
1.000.000	Volkswagen International Finance NV*	3,88 %	29.12.2049	919.327	0,09

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 79,48 % (31. Dezember 2022: 81,63 %) (Fortsetzung)				
	Euro (Fortsetzung)				
2.200.000	Volkswagen Leasing GmbH*	4,50 %	25.03.2026	2.249.425	0,23
2.000.000	VZ Vendor Financing II BV*	2,88 %	15.01.2029	1.761.790	0,18
10.000.000	Westpac Banking Corp*	3,46 %	04.04.2025	10.013.940	1,01
4.000.000	Westpac Securities NZ Ltd*	1,78 %	14.01.2026	3.893.452	0,39
11.000.000	Wizz Air Finance Co BV*	1,00 %	19.01.2026	10.142.231	1,02
100.000	ZF Europe Finance BV*	6,13 %	13.03.2029	106.554	0,01
100.000	ZF Finance GmbH*	2,00 %	06.05.2027	92.699	0,01
	Unternehmensanleihen insgesamt			**789.167.617**	**79,48**
	Staatsanleihen 7,59 % (31. Dezember 2022: 6,87 %)				
	Euro				
5.340.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	3,00 %	30.05.2029	5.220.528	0,53
3.400.000	Bank Gospodarstwa Krajowego*	4,00 %	08.09.2027	3.467.738	0,35
4.000.000	Bulgaria Government International Bond*	4,38 %	13.05.2031	4.209.980	0,42
1.470.000	Bulgaria Government International Bond*	4,88 %	13.05.2036	1.576.891	0,16
1.990.000	European Stability Mechanism*	3,00 %	23.08.2033	2.057.906	0,21
1.700.000	European Union*	3,25 %	04.07.2034	1.783.098	0,18
3.078.000	European Union*	3,38 %	04.10.2038	3.235.628	0,33
1.320.000	French Republic Government Bond OAT*	1,25 %	25.05.2034	1.161.335	0,12
6.839.000	Hellenic Republic Government Bond*	4,38 %	18.07.2038	7.541.246	0,76
1.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	0,25 %	15.03.2028	896.644	0,09
6.807.130	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,30 %	15.05.2028	6.810.384	0,69
3.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	1,75 %	30.05.2024	2.975.286	0,30
2.628.580	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro**	3,10 %	15.09.2026	2.772.915	0,28
3.000.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro*	3,40 %	28.03.2025	3.008.286	0,30
750.000	Italy Government International Bond*	5,13 %	31.07.2024	755.133	0,08
2.000.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT*	3,50 %	18.06.2038	2.099.017	0,21
2.147.000	Romanian Government International Bond*	1,75 %	13.07.2030	1.740.133	0,17
2.900.000	Romanian Government International Bond*	2,12 %	16.07.2031	2.319.893	0,23
4.900.000	Romanian Government International Bond*	3,62 %	26.05.2030	4.517.517	0,45
1.000.000	Romanian Government International Bond*	3,88 %	29.10.2035	855.370	0,09
6.520.000	Romanian Government International Bond*	6,38 %	18.09.2033	6.908.044	0,69
2.200.000	Romanian Government International Bond*	6,63 %	27.09.2029	2.357.172	0,24
1.800.000	Slovenia Government Bond*	1,50 %	25.03.2035	1.523.448	0,15
1.170.000	Slovenia Government Bond*	3,63 %	11.03.2033	1.239.027	0,12
1.850.000	Spain Government Bond*	3,15 %	30.04.2033	1.883.063	0,19
2.356.000	Spain Government Bond*	3,55 %	31.10.2033	2.470.365	0,25
	Staatsanleihen insgesamt			**75.386.047**	**7,59**
	Anlagen insgesamt			**964.201.788**	**97,11**

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto-vermögens
Abgesicherte Klassen CHF						
83.914 CHF	88.753 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	1.594	0,00
7.117.042 CHF	7.481.264 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	9	181.422	0,02
Abgesicherte Klassen USD						
3.670.762 €	4.000.000 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	51.959	0,01
351.664 US$	317.407 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	744	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**235.719**	**0,03**

Futures-Kontrakte 0,05 % (31. Dezember 2022: 1,14 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto-vermögens
74	Euro-BTP Future March 2024	230.880	0,02
733	Euro-Schatz Future March 2024	278.540	0,03
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**509.420**	**0,05**

Inflation-Swap-Kontrakte 0,05 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn EUR	% des Netto-vermögens
EUR 30.000.000	15.11.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,32 %	CPTFEMU	531.378	0,05
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten±						**531.378**	**0,05**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

	Zeitwert EUR	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**965.478.305**	**97,24**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,25 %) (31. Dezember 2022: (0,80 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Netto-vermögens
Abgesicherte Klassen CHF						
795.822 €	756.969 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	15	(19.184)	(0,00)
Abgesicherte Klassen USD						
1.799.543 US$	1.670.563 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	(42.515)	(0,00)
71.478.211 US$	67.116.763 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	5	(2.450.379)	(0,25)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(2.512.078)**	**(0,25)**

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures- Kontrakte (0,28 %) (31. Dezember 2022: (0,21 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
428	Euro-BOBL Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 118.00	(83.676)	(0,01)
(549)	Euro-BOBL Future March 2024	(466.180)	(0,05)
(355)	Euro-Bund Future March 2024	(983.350)	(0,10)
(101)	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024	(715.080)	(0,07)
(295)	Euro-OAT Future March 2024	(535.400)	(0,05)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(2.783.686)**	**(0,28)**

Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,22 %) (31. Dezember 2022: (0,07 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Referenzverbindlichkeit	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
EUR	27.200.000	20.12.2028	ICE Clear U.S.[1]	Buying default protection on iTRAXX Europe Crossover S40.V1	(2.179.454)	(0,22)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt ±					**(2.179.454)**	**(0,22)**

[1]Zentral abgewickelter Swap.

Inflation-Swap-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
EUR	30.000.000	15.11.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	2,21 %	CPTFEMU	(293.227)	(0,03)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten∞							**(293.227)**	**(0,03)**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Zinsswap-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,21 %))

	Nominalwert	Fälligkeit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust EUR	% des Nettovermögens
EUR	12.479.054	30.08.2032	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,22 %	6M EURIBOR	(248.422)	(0,03)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten ∞							**(248.422)**	**(0,03)**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Ultra Short Term Euro Bond - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(8.016.867)**	**(0,81)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**957.461.438**	**96,43**
Sonstiges Nettovermögen	**35.410.860**	**3,57**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**992.872.298**	**100,00**

Portfolioanalyse		**EUR**	**% des Gesamtvermögens**
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	795.099.743	79,37
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	169.102.045	16,88
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(2.274.266)	(0,23)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(4.466.084)	(0,45)
Anlagen insgesamt		**957.461.438**	**95,57**

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 4,75 % (31. Dezember 2022: 4,32 %)		
	Euro		
34	Deutsche Lufthansa AG	302	0,00
80.000	Epic Acquisition Corp	901.395	0,05
59.626	Siemens Energy AG	790.390	0,05
	Euro insgesamt	**1.692.087**	**0,10**
	Schweizer Franken		
12.600	ams-OSRAM AG	31.648	0,00
	Schweizer Franken insgesamt	**31.648**	**0,00**
	US-Dollar		
12.342	AbbVie Inc	1.912.640	0,12
2.394	Advanced Energy Industries Inc	260.754	0,02
5.507	Advanced Micro Devices Inc	811.787	0,05
501	AeroVironment Inc	63.146	0,00
1.363	Align Technology Inc	373.462	0,02
1.881	Ameriprise Financial Inc	714.460	0,04
14.279	Apellis Pharmaceuticals Inc	854.741	0,05
8.860	Apple Inc	1.705.816	0,10
400	Applied Materials Inc	64.828	0,00
3.136	Autodesk Inc	763.553	0,05
2.187	Axon Enterprise Inc	564.968	0,03
5.086	Bath & Body Works Inc	219.512	0,01
500	Berkshire Hathaway Inc Class B	178.330	0,01
14.707	Best Buy Co Inc	1.151.264	0,07
969	BlackRock Inc Class A	786.634	0,05
3.889	Boyd Gaming Corp	243.490	0,02
600	Broadcom Inc	669.750	0,04
12.532	Cardinal Health Inc	1.263.226	0,08
900	CarMax Inc	69.066	0,00
2.618	CDW Corp	595.124	0,04
2.334	Cencora Inc	479.357	0,03
1.110	Charles Schwab Corp	76.368	0,00
12.008	Chemours Co	378.732	0,02
277	Chipotle Mexican Grill Inc Class A	633.488	0,04
60.554	Cleveland-Cliffs Inc	1.236.513	0,08
12.990	Commercial Metals Co	650.020	0,04
18.056	Confluent Inc Class A	422.510	0,03
8.568	CONMED Corp	938.282	0,06
5.754	Coty Inc Class A	71.465	0,00
330	CVS Health Corp	26.057	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 4,75 % (31. Dezember 2022: 4,32 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
9.696	Dave & Buster's Entertainment Inc	522.130	0,03
45.110	Devon Energy Corp	2.043.483	0,13
6.165	Dexcom Inc	765.015	0,05
14.102	Dick's Sporting Goods Inc	2.072.289	0,13
15.294	DISH Network Corp Class A Class A	88.246	0,01
1.117	Dollar Tree Inc	158.670	0,01
880	Domino's Pizza Inc	362.762	0,02
2.174	Eagle Materials Inc	440.974	0,03
11.072	EQT Corp	428.043	0,03
275	Etsy Inc	22.289	0,00
330	Fair Isaac Corp	384.123	0,02
3.045	FedEx Corp	770.294	0,05
7	Five Below Inc	1.492	0,00
8.326	Fortinet Inc	487.321	0,03
21.284	Freeport-McMoRan Inc	906.060	0,06
9.474	Guardant Health Inc	256.272	0,02
1.875	Halliburton Co	67.781	0,00
3.132	Hess Corp	451.509	0,03
21.174	HP Inc	637.126	0,04
13.012	ITT Inc	1.552.592	0,10
18.777	Kroger Co	858.297	0,05
539	Lam Research Corp	422.177	0,03
5.899	Louisiana-Pacific Corp	417.826	0,03
1.174	Lowe's Cos Inc	261.274	0,02
665	Lululemon Athletica Inc	340.008	0,02
4.266	LyondellBasell Industries NV Class A	405.611	0,03
66.074	Marathon Oil Corp	1.596.348	0,10
3.927	Meta Platforms Inc Class A	1.390.001	0,09
1.512	Microchip Technology Inc	136.352	0,01
12.401	Micron Technology Inc	1.058.301	0,07
1.474	Microsoft Corp	554.283	0,03
7.700	NetApp Inc	678.832	0,04
2.397	Netflix Inc	1.167.051	0,07
4.010	Neurocrine Biosciences Inc	528.358	0,03
71.857	NIO Inc ADR	651.743	0,04
1.078	Nucor Corp	187.615	0,01
3.617	NVIDIA Corp	1.791.211	0,11
4.145	ON Semiconductor Corp	346.232	0,02
25.277	ONEOK Inc	1.774.951	0,11
914	Palo Alto Networks Inc	269.520	0,02

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 4,75 % (31. Dezember 2022: 4,32 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
64.558	PG&E Corp	1.163.981	0,07
1.054	Pioneer Natural Resources Co	237.023	0,01
9.297	Prudential Financial Inc	964.192	0,06
10.850	Qorvo Inc	1.221.818	0,08
4.633	Ralph Lauren Corp Class A	668.079	0,04
17.660	Range Resources Corp	537.570	0,03
2.560	RH	746.189	0,05
101.707	Sarepta Therapeutics Inc	9.807.606	0,60
2.558	Seagate Technology Holdings Plc	218.376	0,01
16.916	Semtech Corp	370.630	0,02
1.140	ServiceNow Inc	805.399	0,05
1.275	Sherwin-Williams Co	397.672	0,02
401	Sibanye Stillwater Ltd ADR	2.177	0,00
2.197	Signet Jewelers Ltd	235.650	0,01
10.109	Skechers USA Inc Class A	630.195	0,04
3.149	Skyworks Solutions Inc	354.011	0,02
22.822	Sunnova Energy International Inc	348.035	0,02
9.050	T Rowe Price Group Inc	974.594	0,06
10.744	Take-Two Interactive Software Inc	1.729.247	0,11
21.470	Targa Resources Corp	1.865.099	0,11
3.819	TD SYNNEX Corp	410.963	0,03
8.784	Tenet Healthcare Corp	663.807	0,04
150	Tesla Inc	37.272	0,00
600	Texas Instruments Inc	102.276	0,01
3.263	Thor Industries Inc	385.850	0,02
10.380	United States Steel Corp	504.987	0,03
1.909	Universal Display Corp	365.115	0,02
4.242	Valero Energy Corp	551.460	0,03
3.503	Voya Financial Inc	255.579	0,02
960	Walmart Inc	151.344	0,01
186	West Pharmaceutical Services Inc	65.494	0,00
9.525	Western Digital Corp	498.824	0,03
1.446	Wingstop Inc	371.015	0,02
8.266	Winnebago Industries Inc	602.426	0,04
6.243	Wolfspeed Inc	271.633	0,02
7.141	Wynn Resorts Ltd	650.616	0,04
45.522	ZTO Express Cayman Inc ADR	968.708	0,06
	US-Dollar insgesamt	**75.568.717**	**4,65**
	Aktien insgesamt *	**77.292.452**	**4,75**

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Immobilienaktiengesellschaften 0,07 % (31. Dezember 2022: 0,16 %)		
	US-Dollar		
5.983	Simon Property Group Inc	853.415	0,05
13.140	Tanger Inc	364.241	0,02
	Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *	**1.217.656**	**0,07**

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Fälligkeitsdatum	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Participatory Notes 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)			
	Euro			
40.000	Epic Acquisition Corp	06.12.2026	2.209	0,00
	Euro insgesamt		**2.209**	**0,00**
	Britisches Pfund			
50.000	New Energy One Acquisition Corp Plc	07.03.2027	14.342	0,00
	Britisches Pfund insgesamt		**14.342**	**0,00**
	US-Dollar			
16.000	Merrill Lynch BV	15.03.2024	20.480	0,00
2.000	Merrill Lynch International & Co CV	19.01.2024	14	0,00
	US-Dollar insgesamt		**20.494**	**0,00**
	Participatory Notes insgesamt **		**37.045**	**0,00**

Kapitalbetrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Schatzwechsel 43,48 % (31. Dezember 2022: 50,57 %)				
	US-Dollar				
100.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	04.01.2024	99.970.968	6,14
110.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	09.01.2024	109.887.939	6,76
125.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	16.01.2024	124.744.670	7,67
125.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	01.02.2024	124.451.224	7,65
125.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	15.02.2024	124.200.055	7,64
125.000.000	United States Treasury Bill	0,00 %	29.02.2024	123.940.845	7,62
	Schatzwechsel insgesamt **			**707.195.701**	**43,48**
	Unternehmensanleihen 7,41 % (31. Dezember 2022: 5,16 %)				
	Euro				
500.000	BNP Paribas SA**	0,00 %	03.01.2025	668.976	0,04
	Euro insgesamt			**668.976**	**0,04**

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 7,41 % (31. Dezember 2022: 5,16 %) (Fortsetzung)				
	Japanischer Yen				
200.000.000	Taiyo Yuden Co Ltd[*]	0,00 %	18.10.2030	1.549.865	0,09
	Japanischer Yen insgesamt			**1.549.865**	**0,09**
	US-Dollar				
4.000.000	2001 Cat RE Ltd[**]	18,00 %	08.01.2024	3.992.600	0,25
3.000.000	Alamo Re Ltd[**]	13,84 %	07.06.2026	3.062.925	0,19
3.000.000	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC[**]	13,64 %	10.06.2024	3.021.975	0,19
2.250.000	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity Co[**]	15,09 %	06.06.2025	2.305.800	0,14
2.250.000	Blue Halo Re Ltd[*]	15,10 %	24.02.2025	2.252.700	0,14
750.000	Blue Ridge Re Ltd[**]	8,00 %	08.01.2027	750.375	0,05
3.000.000	Bonanza RE Ltd[**]	13,60 %	08.01.2026	3.004.650	0,19
2.400.000	Cape Lookout Re Ltd[**]	10,70 %	28.03.2025	2.375.160	0,15
4.500.000	Cape Lookout Re Ltd[**]	11,85 %	28.04.2026	4.588.312	0,28
5.000.000	Finca RE Ltd[**]	13,34 %	06.06.2025	5.107.625	0,31
3.750.000	Gateway Re II Ltd[**]	14,85 %	27.04.2026	3.792.000	0,23
3.000.000	Gateway Re Ltd[**]	18,35 %	24.02.2026	3.128.025	0,19
80.000.000	Goldman Sachs International[†]	0,00 %	23.01.2024	8.000	0,00
1.500.000	Herbie Re Ltd[**]	14,65 %	08.07.2024	1.519.800	0,09
2.000.000	Herbie Re Ltd[**]	15,07 %	08.01.2025	1.973.000	0,12
1.500.000	Herbie Re Ltd[*]	23,65 %	06.06.2025	1.087.500	0,07
5.125.000	Hestia Re Ltd[**]	14,72 %	22.04.2025	4.838.000	0,30
3.000.000	Hestia Re Ltd[**]	15,10 %	07.04.2026	3.069.675	0,19
3.800.000	Kilimanjaro III Re Ltd[**]	5,25 %	25.06.2025	3.813.680	0,24
3.500.000	L&F Co Ltd[*]	2,50 %	26.04.2030	2.405.900	0,15
4.750.000	Lightning Re Series 2023-1[**]	16,34 %	31.03.2026	5.025.262	0,31
4.420.000	Montoya Re Ltd[*]	12,46 %	07.04.2025	4.454.255	0,27
5.100.000	Mystic Re IV Ltd[*]	15,10 %	08.01.2024	5.096.175	0,31
5.250.000	Northshore Re II Ltd[*]	11,10 %	08.01.2024	5.240.156	0,32
1.500.000	Pelican IV Re Ltd[**]	5,86 %	07.05.2024	26.363	0,00
3.000.000	Purple Re Ltd[**]	17,59 %	24.04.2026	2.988.375	0,18
4.000.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd[**]	7,85 %	06.06.2025	3.826.400	0,24
3.185.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd[**]	9,01 %	06.06.2025	2.965.872	0,18
2.425.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd[**]	10,86 %	06.06.2025	2.133.636	0,13
1.500.000	Residential Reinsurance 2021 Ltd[*]	15,28 %	06.06.2025	1.300.950	0,08
1.500.000	Residential Reinsurance 2022 Ltd[**]	10,67 %	06.06.2026	1.343.100	0,08
3.000.000	Residential Reinsurance 2022 Ltd[**]	15,43 %	06.12.2026	3.115.650	0,19
2.050.000	Sanders Re III Ltd[**]	11,60 %	07.04.2027	2.089.514	0,13
3.000.000	Sanders Re III Ltd[**]	15,50 %	07.04.2027	2.632.050	0,16
3.500.000	Sanders Re III Ltd[*]	17,11 %	07.04.2026	2.756.950	0,17
3.250.000	Sussex Capital UK Pcc Ltd[**]	13,74 %	08.01.2025	3.209.050	0,20

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 7,41 % (31. Dezember 2022: 5,16 %) (Fortsetzung)				
	US-Dollar (Fortsetzung)				
4.750.000	Titania RE Ltd**	17,60 %	27.02.2026	5.093.188	0,31
4.250.000	Topanga Re Ltd**	8,66 %	08.01.2026	3.945.488	0,24
2.000.000	Ursa Re II Ltd**	10,36 %	16.06.2025	1.982.150	0,12
3.000.000	Ursa Re II Ltd**	12,36 %	06.12.2025	3.077.700	0,19
	US-Dollar insgesamt			**118.399.986**	**7,28**
	Unternehmensanleihen insgesamt			**120.618.827**	**7,41**
	Staatsanleihen 2,40 % (31. Dezember 2022: 0,13 %)				
	Polnischer Zloty				
14.200.000	Republic of Poland Government Bond	1,75 %	25.04.2032	2.810.381	0,17
	Polnischer Zloty insgesamt			**2.810.381**	**0,17**
	Südafrikanischer Rand				
335.000.000	Republic of South Africa Government Bond	8,75 %	31.01.2044	13.608.831	0,84
	Südafrikanischer Rand insgesamt			**13.608.831**	**0,84**
	US-Dollar				
8.585.000	Ukraine Government International Bond	7,75 %	01.08.2041	3.872.754	0,24
14.400.000	Ukraine Government International Bond	7,38 %	25.09.2034	3.420.720	0,21
55.000.000	Ukraine Government International Bond	7,75 %	01.09.2029	15.251.885	0,94
	US-Dollar insgesamt			**22.545.359**	**1,39**
	Staatsanleihen insgesamt *			**38.964.571**	**2,40**
	Anlagen insgesamt			**945.326.252**	**58,11**

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
110.000 AUD	74.024 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	1.211	0,00
1.450.000 AUD	983.861 US$	20.03.2024	BNP Paribas	6	7.866	0,00
3.710.000 AUD	2.481.670 US$	20.03.2024	Citibank NA	12	55.785	0,00
540.000 AUD	366.094 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	7	3.239	0,00
31.386.088 AUD	16.625.000 £	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	7	226.804	0,01
43.514.397 AUD	29.398.983 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	10	299.804	0,02
222.457 AUD	239.131 NZD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	418	0,00
23.200.000 AUD	20.794.426 CAD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	62.276	0,00
27.802.893 AUD	17.000.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	191.536	0,02
42.000.000 AUD	4.005.830.346 ¥	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	219.655	0,02
520.000 AUD	349.842 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	6	5.813	0,00
4.920.000 AUD	463.518.612 ¥	21.03.2024	UBS AG	2	36.656	0,01
470.000 AUD	317.425 US$	20.03.2024	UBS AG	7	4.029	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
16.990.000 BRL	3.400.335 US$	20.03.2024	BNP Paribas	2	71.690	0,00
680.000 BRL	138.780 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	182	0,00
2.420.000 BRL	493.053 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	3	1.491	0,00
128.124.582 BRL	26.201.115 US$	03.01.2024	JPMorgan Chase Bank	91	174.992	0,00
19.468.110 BRL	4.000.000 US$	02.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	804	0,00
1.160.000 BRL	235.976 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	3	1.078	0,00
220.000 CAD	164.978 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	2	2.044	0,00
1.530.000 CAD	1.153.892 US$	20.03.2024	BNP Paribas	6	7.669	0,00
310.000 CAD	232.963 US$	20.03.2024	Citibank NA	3	2.386	0,00
1.380.000 CAD	1.032.284 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	9	15.399	0,00
11.336.278 CAD	7.750.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	34.839	0,01
157.200.000 CAD	116.829.086 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	9	2.401.558	0,14
541.678 CAD	600.000 AUD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.340	0,00
5.070.000 CAD	3.829.810 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	27	19.278	0,00
2.440.000 CAD	1.841.300 US$	20.03.2024	UBS AG	16	11.124	0,00
6.330.000 CHF	7.296.068 US$	20.03.2024	Citibank NA	5	285.206	0,02
100.000 CHF	117.172 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	2.595	0,00
8.000.000 CHF	9.170.790 US$	05.01.2024	Goldman Sachs International	1	336.326	0,02
40.975.456 CHF	43.375.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	793.206	0,05
10.573.512 CHF	9.625.000 £	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	301.593	0,02
14.750.000 CHF	2.449.110.610 ¥	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	146.668	0,01
25.875.000 CHF	29.879.124 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	7	886.503	0,05
770.000 CHF	894.843 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	11	27.367	0,00
180.000 CHF	210.633 US$	20.03.2024	UBS AG	3	4.947	0,00
46.840.000 CLP	53.092 US$	20.03.2024	Citibank NA	2	330	0,00
87.765.781 CLP	100.000 US$	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	470	0,00
612.377.138 CLP	700.000 US$	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.075	0,00
530.403.469 CLP	600.000 US$	04.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	7.353	0,00
27.370.000 CLP	30.843 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	372	0,00
38.486.815 CNY	5.400.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	7.806	0,00
811.037.200 COP	200.000 US$	05.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	9.272	0,00
1.617.897.515 COP	400.000 US$	09.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	17.142	0,00
1.206.180.900 COP	300.000 US$	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	10.856	0,00
395.781.000 COP	100.000 US$	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.977	0,00
395.513.913 COP	100.000 US$	16.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.813	0,00
398.637.907 COP	100.000 US$	18.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.570	0,00
2.786.762.696 COP	700.000 US$	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	16.871	0,00
10.240.000 CZK	455.445 US$	20.03.2024	BNP Paribas	4	1.788	0,00
2.480.000 CZK	110.725 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	11	0,00
6.748.069 CZK	300.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.870	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
4.340.000 CZK	193.300 US$	20.03.2024	Royal Bank of Scotland	1	489	0,00
2.870.000 CZK	127.754 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	396	0,00
3.030.000 €	3.307.826 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	13	49.771	0,00
380.000 €	13.189.779 TRY	20.03.2024	Barclays Bank Plc	3	5.764	0,00
553.716 €	2.410.000 PLN	20.03.2024	BNP Paribas	2	1.350	0,00
80.000 €	88.042 US$	20.03.2024	BNP Paribas	1	607	0,00
2.500.000 €	85.742.344 TRY	20.03.2024	Citibank NA	3	70.427	0,00
417.644 €	1.820.000 PLN	20.03.2024	Citibank NA	5	448	0,00
120.000 €	132.002 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	2	973	0,00
158.501 €	690.000 PLN	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	352	0,00
47.000.000 €	51.523.515 US$	05.01.2024	Goldman Sachs International	1	398.999	0,03
1.000.000 €	1.061.000 US$	31.01.2024	Goldman Sachs International	1	44.976	0,00
200.000 €	865.362 PLN	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	939	0,00
20.000.000 €	17.184.419 £	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	191.381	0,01
54.875.000 €	59.828.145 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	805.742	0,06
700.000 €	108.520.895 ¥	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.851	0,00
1.250.000 €	2.022.188 AUD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.029	0,00
80.000 €	2.755.413 TRY	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.886	0,00
1.100.000 €	420.536.171 HUF	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.264	0,00
50.516 €	220.000 PLN	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	89	0,00
1.600.000 €	1.766.944 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	14	6.046	0,00
1.310.781 €	5.700.000 PLN	20.03.2024	UBS AG	11	4.482	0,00
5.620.000 £	7.066.522 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	3	100.611	0,01
40.000 £	50.813 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	198	0,00
30.000 £	37.823 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	2	435	0,00
7.000.000 £	8.813.316 US$	05.01.2024	Goldman Sachs International	1	110.383	0,01
38.079.545 £	48.243.833 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	301.813	0,02
250.000 £	267.840 CHF	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	247	0,00
60.000 £	76.209 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	2	308	0,00
170.000.000 HKD	21.773.935 US$	26.01.2024	Citibank NA	1	9.294	0,00
1.161.570.000 HUF	3.279.001 US$	20.03.2024	BNP Paribas	8	49.210	0,00
66.610.000 HUF	187.747 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	3.108	0,00
124.370.000 HUF	355.254 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	1.099	0,00
66.640.000 HUF	187.799 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	3.143	0,00
4.576.324.067 HUF	13.000.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	212.806	0,01
422.209.370 HUF	1.100.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	3.567	0,00
21.770.000 HUF	61.577 US$	20.03.2024	UBS AG	1	800	0,00
1.930.000 ILS	534.294 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	5	2.928	0,00
2.100.000 ILS	569.065 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	15.478	0,00
550.000 ILS	151.108 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	2	1.987	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
2.915.159 ILS	800.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	9.620	0,00
560.000 ILS	152.748 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	2	3.131	0,00
1.120.000 ILS	306.471 US$	20.03.2024	UBS AG	3	5.286	0,00
212.670.000 INR	2.545.337 US$	20.03.2024	BNP Paribas	8	1.323	0,00
933.504.162 INR	11.198.376 US$	08.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	16.764	0,00
2.399.132.985 INR	28.815.070 US$	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	3.781	0,00
283.052.869 INR	3.400.000 US$	05.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.151	0,00
267.004.386 INR	3.205.724 US$	04.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.761	0,00
2.090.000 INR	24.995 US$	20.03.2024	Société Générale	1	32	0,00
23.220.000 ¥	165.271 US$	21.03.2024	Barclays Bank Plc	4	1.470	0,00
65.018.500 ¥	680.000 AUD	21.03.2024	Citibank NA	8	1.792	0,00
94.960.000 ¥	678.746 US$	21.03.2024	Citibank NA	10	3.149	0,00
30.630.000 ¥	218.789 US$	21.03.2024	Deutsche Bank AG	5	1.163	0,00
6.614.505.471 ¥	36.625.000 £	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	278.526	0,02
42.056.378 ¥	250.000 CHF	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.392	0,00
6.200.000.000 ¥	43.263.063 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	763.367	0,05
35.942.950 ¥	400.000 NZD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.965	0,00
1.427.421.416 ¥	14.800.000 AUD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	35.100	0,01
43.180.452 ¥	400.000 CAD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	3.240	0,00
379.146.535 ¥	2.400.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	4	40.465	0,01
15.409.276 ¥	160.000 AUD	21.03.2024	Royal Bank of Scotland	3	1.217	0,00
76.050.000 ¥	541.386 US$	21.03.2024	State Street Bank and Trust Co	12	4.718	0,00
19.112.619 ¥	200.000 AUD	21.03.2024	State Street Bank and Trust Co	4	451	0,00
37.173.609 ¥	390.000 AUD	21.03.2024	UBS AG	3	192	0,00
96.110.000 KRW	74.290 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	169	0,00
206.850.000 KRW	159.203 US$	20.03.2024	Citibank NA	2	1.049	0,00
129.643.368 KRW	100.000 US$	22.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	69	0,00
779.876.875 KRW	600.000 US$	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.456	0,00
1.957.120.424 KRW	1.500.000 US$	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	10	9.485	0,00
4.478.004.000 KRW	3.400.000 US$	16.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	54.864	0,00
5.098.328.212 KRW	3.900.000 US$	04.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	54.755	0,00
1.163.011.300 KRW	900.000 US$	05.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.260	0,00
129.752.468 KRW	100.000 US$	29.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	208	0,00
259.876.958 KRW	200.000 US$	08.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	798	0,00
1.299.010.000 KRW	1.000.000 US$	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.445	0,00
149.040.000 KRW	114.390 US$	20.03.2024	UBS AG	1	1.075	0,00
55.730.000 MXN	3.159.084 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	2	90.499	0,00
10.670.000 MXN	609.152 US$	20.03.2024	Citibank NA	2	13.009	0,00
15.140.000 MXN	875.162 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	4	7.643	0,00
2.140.000 MXN	123.312 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.470	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
476.821.918 MXN	27.232.390 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	893.886	0,06
1.020.000 MXN	58.434 US$	20.03.2024	UBS AG	1	1.041	0,00
11.740.000 NOK	1.127.374 US$	20.03.2024	BNP Paribas	10	30.633	0,00
1.530.000 NOK	148.667 US$	20.03.2024	Citibank NA	3	2.250	0,00
6.560.000 NOK	626.669 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	5	20.394	0,00
198.194.241 NOK	17.250.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	458.778	0,03
171.112.767 NOK	16.300.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	4	551.979	0,03
55.745.979 NOK	54.473.577 SEK	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	83.347	0,01
14.670.000 NOK	1.404.250 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	15	42.767	0,00
3.570.000 NOK	342.995 US$	20.03.2024	UBS AG	5	9.142	0,00
1.320.000 NZD	830.734 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	3	5.177	0,00
260.000 NZD	162.606 US$	20.03.2024	Citibank NA	3	2.044	0,00
216.051 NZD	200.000 AUD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	296	0,00
29.100.000 NZD	18.086.797 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	4	338.375	0,03
29.800.000 NZD	2.654.040.168 ¥	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	21.953	0,01
80.000 NZD	49.892 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	769	0,00
410.000 NZD	257.798 US$	20.03.2024	Royal Bank of Scotland	4	1.841	0,00
1.210.000 NZD	762.654 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	10	3.598	0,00
3.000.000 NZD	1.850.177 US$	20.03.2024	UBS AG	8	49.619	0,00
6.610.000 PHP	118.932 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	390	0,00
166.540.000 PHP	2.993.310 US$	20.03.2024	BNP Paribas	5	13.032	0,00
337.860.000 PHP	6.051.298 US$	20.03.2024	UBS AG	5	47.673	0,00
33.100.000 PLN	7.583.573 €	20.03.2024	BNP Paribas	2	5.184	0,01
18.250.000 PLN	4.537.286 US$	20.03.2024	BNP Paribas	3	98.919	0,01
350.000 PLN	88.332 US$	20.03.2024	Citibank NA	3	582	0,00
120.000 PLN	30.333 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	152	0,00
77.931.931 PLN	19.500.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	317.155	0,02
20.000 PLN	5.056 US$	20.03.2024	UBS AG	1	25	0,00
280.000 SEK	26.882 US$	20.03.2024	BNP Paribas	1	987	0,00
45.230.000 SEK	4.349.903 US$	20.03.2024	Citibank NA	4	151.886	0,01
3.073.512 SEK	300.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	5.061	0,00
1.408.081 SEK	125.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.641	0,00
740.000 SEK	73.103 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	550	0,00
1.040.000 SGD	786.526 US$	20.03.2024	BNP Paribas	2	4.718	0,00
12.840.000 SGD	9.656.053 US$	20.03.2024	Citibank NA	9	112.775	0,00
55.592.480 SGD	41.600.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	558.025	0,04
400.000 SGD	301.483 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	2.842	0,00
200.000 SGD	151.209 US$	20.03.2024	UBS AG	1	953	0,00
4.340.000 THB	125.999 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	3	2.007	0,00
25.840.000 THB	747.660 US$	20.03.2024	BNP Paribas	4	14.484	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
56.980.000 THB	1.645.180 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	5	35.432	0,00
44.200.000 THB	1.277.608 US$	20.03.2024	Royal Bank of Scotland	2	26.060	0,00
16.936.071 TRY	480.000 €	20.03.2024	Citibank NA	9	1.389	0,00
5.951.550 TRY	200.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	346	0,00
1.112.037.500 TWD	35.500.000 US$	02.02.2024	Bank of America Merrill Lynch	1	1.121.139	0,07
667.861.500 TWD	21.300.000 US$	02.02.2024	Goldman Sachs International	1	693.727	0,04
1.113.280.000 TWD	35.500.000 US$	15.02.2024	HSBC Bank Plc	1	1.228.096	0,08
444.957.000 TWD	14.200.000 US$	05.02.2024	HSBC Bank Plc	1	459.214	0,03
1.335.936.000 TWD	42.600.000 US$	16.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.479.823	0,09
232.236.376 TWD	7.393.587 US$	04.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	180.615	0,01
3.117.186 TWD	100.000 US$	08.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.051	0,00
24.857.066 TWD	800.000 US$	26.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	17.586	0,00
245.925.901 TWD	7.900.000 US$	16.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	174.845	0,01
156.318.680 TWD	5.040.469 US$	18.01.2024	JPMorgan Chase Bank	9	93.953	0,00
3.106.386 TWD	100.000 US$	22.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.103	0,00
6.123.652 TWD	200.000 US$	29.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.521	0,00
112.999.312 TWD	3.700.000 US$	31.01.2024	JPMorgan Chase Bank	4	19.951	0,00
6.217.167 TWD	200.000 US$	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	3.996	0,00
6.231.574 TWD	200.000 US$	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	4.433	0,00
96.388 US$	80.000 CHF	20.03.2024	Barclays Bank Plc	2	573	0,00
306.145 US$	240.000 £	20.03.2024	Barclays Bank Plc	2	75	0,00
165.496 US$	650.000 PLN	20.03.2024	BNP Paribas	1	371	0,00
587.654 US$	49.070.000 INR	20.03.2024	BNP Paribas	2	56	0,00
77.374 US$	2.440.000 TRY	20.03.2024	BNP Paribas	3	543	0,00
177.238 US$	61.690.000 HUF	20.03.2024	BNP Paribas	1	479	0,00
503.194 US$	5.000.000 SEK	20.03.2024	BNP Paribas	5	5.539	0,00
685.361 US$	900.000 SGD	20.03.2024	Citibank NA	3	631	0,00
109.850 US$	9.170.000 INR	20.03.2024	Citibank NA	1	42	0,00
84.247 US$	70.000 CHF	20.03.2024	Citibank NA	1	410	0,00
185.529 US$	730.000 PLN	20.03.2024	Deutsche Bank AG	5	80	0,00
3.550.000 US$	2.857.750.000 NGN	22.01.2024	Goldman Sachs International	1	610.278	0,04
14.440.400 US$	13.000.000 €	02.01.2024	Goldman Sachs International	1	79.948	0,01
320.411 US$	2.500.000 HKD	05.01.2024	Goldman Sachs International	1	237	0,00
1.162.917 US$	1.700.000 AUD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	2.659	0,00
500.000 US$	432.531.782 CLP	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	4.858	0,00
3.550.000 US$	2.864.850.000 NGN	22.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	602.974	0,04
600.000 US$	522.624.715 CLP	04.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.554	0,00
500.000 US$	14.823.688 TRY	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	4	995	0,00
148.647 US$	125.000 CHF	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	21	0,00
7.100.000 US$	5.754.550.000 NGN	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.065.458	0,06

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
24.183.739 US$	2.009.451.451 INR	22.01.2024	JPMorgan Chase Bank	28	57.736	0,00
100.000 US$	8.331.131 INR	29.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	6	0,00
800.000 US$	687.624.592 CLP	08.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	12.684	0,00
1.244.391 US$	1.125.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.327	0,00
2.689.560 US$	81.553.858 TWD	05.02.2024	JPMorgan Chase Bank	6	2.748	0,00
1.300.000 US$	6.315.967 BRL	02.02.2024	JPMorgan Chase Bank	7	2.034	0,00
768.213 US$	13.000.000 MXN	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.383	0,00
28.435.431 US$	2.369.397.787 INR	02.02.2024	JPMorgan Chase Bank	2	1.861	0,00
900.000 US$	1.162.602.000 KRW	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	3.310	0,00
100.000 US$	390.114 PLN	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	799	0,00
4.800.000 US$	23.262.378 BRL	03.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	11.137	0,00
300.000 US$	3.033.679 NOK	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	1.229	0,00
6.079.639 US$	505.695.090 INR	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	7.313	0,00
7.400.000 US$	9.555.755.081 KRW	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	12	25.835	0,00
400.000 US$	345.532.000 CLP	22.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	4.758	0,00
800.000 US$	695.312.008 CLP	18.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	4.410	0,00
500.000 US$	644.431.663 KRW	04.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	117	0,00
14.400.000 US$	577.440.000 EGP	20.03.2024	Morgan Stanley	1	1.237.039	0,08
754.046 US$	590.000 £	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	5	1.626	0,00
373.240 US$	310.000 CHF	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	7	1.962	0,00
388.270 US$	350.000 €	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	7	427	0,00
12.923 US$	410.000 TRY	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	12	0,00
31.717 US$	50.000 NZD	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	54	0,00
218.911 US$	4.900.000 CZK	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	117	0,00
34.276 US$	50.000 AUD	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	79	0,00
361.988 US$	1.420.000 PLN	20.03.2024	UBS AG	5	1.252	0,00
139.869 US$	11.680.000 INR	20.03.2024	UBS AG	1	5	0,00
180.663 US$	1.810.000 SEK	20.03.2024	UBS AG	3	512	0,00
2.615.425 US$	82.620.000 TRY	20.03.2024	UBS AG	2	13.875	0,00
7.210.000 ZAR	385.521 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	3	6.068	0,00
3.940.000 ZAR	213.011 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	3	978	0,00
24.132.477 ZAR	1.300.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	18.860	0,00
3.430.000 ZAR	185.109 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	3	1.180	0,00
Abgesicherte Klassen CHF						
2.811.012 CHF	3.140.384 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	204.947	0,01
71.792 CHF	80.583 US$	18.01.2024	UBS AG	4	4.856	0,00
2.970.447 CHF	3.323.131 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	13	211.938	0,02
15.708 US$	13.185 CHF	18.01.2024	UBS AG	1	16	0,00
9.655 US$	8.063 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	59	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 5,65 % (31. Dezember 2022: 6,78 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
450.774 €	480.564 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	17.693	0,00
20.855.189 €	22.204.670 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	847.354	0,05
21.014.712 €	22.397.886 US$	18.01.2024	UBS AG	2	830.465	0,05
715.941 €	768.184 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	35	23.176	0,00
192.159 US$	173.431 €	18.01.2024	UBS AG	1	460	0,00
230.279 US$	207.209 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	1.243	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
5.749.654 £	7.062.530 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	267.772	0,02
11.499.983 £	14.137.567 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	523.896	0,03
1.307.569.327 £	1.604.918.204 US$	18.01.2024	UBS AG	5	62.117.329	3,82
66.582.105 £	83.043.310 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	42	1.843.004	0,12
7.871.393 US$	6.153.780 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	25.866	0,00
4.420.721 US$	3.460.814 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	8.488	0,00
Abgesicherte Klassen JPY						
38.060.740 ¥	255.747 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	14.877	0,00
76.467.122 ¥	514.202 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	29.504	0,00
24.070.054 ¥	168.765 US$	18.01.2024	UBS AG	1	2.381	0,00
3.989.328.650 ¥	27.231.711 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	1.133.658	0,07
Abgesicherte Klassen SGD						
44.215 SGD	32.541 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	1.003	0,00
3.996 SGD	2.945 US$	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	86	0,00
46.465 SGD	34.118 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	14	1.133	0,00
46 US$	60 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	0	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞]					**91.871.867**	**5,65**

Futures-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,30 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
872	1 Month SOFR Future February 2024	90.233	0,01
11	10-Year Mini Japanese Government Bond Future March 2024	1.456	0,00
(11)	3 Month SOFR Future December 2024	102.551	0,01
50	3 Month SOFR Future December 2025	28.900	0,00
1.711	3 Month SOFR Future June 2024	720.809	0,05
104	3 Month SOFR Future June 2025	122.535	0,01
75	3 Month SOFR Future June 2026	37.662	0,00
100	3 Month SOFR Future March 2024	4.375	0,00
103	3 Month SOFR Future March 2025	113.765	0,01
51	3 Month SOFR Future March 2026	32.475	0,00
476	3 Month SOFR Future September 2024	183.040	0,01
35	3 Month SOFR Future September 2025	16.450	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,30 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
77	3 Month SOFR Future September 2026	22.012	0,00
87	3 Month SOFR Future September 2027	15.525	0,00
327	3 Month SONIA Future December 2024	160.101	0,01
26	3 Month SONIA Future December 2025	41.192	0,00
341	3 Month SONIA Future June 2024	69.848	0,01
28	3 Month SONIA Future June 2025	21.751	0,00
28	3 Month SONIA Future June 2026	38.818	0,00
405	3 Month SONIA Future March 2025	340.440	0,02
28	3 Month SONIA Future March 2026	39.822	0,00
970	3 Month SONIA Future September 2024	1.388.920	0,09
26	3 Month SONIA Future September 2025	23.456	0,00
29	3 Month SONIA Future September 2026	22.580	0,00
1.199	30 Day Federal Funds Future January 2024	18.929	0,00
89	3-Month Euro EURIBOR Future December 2024	44.628	0,00
39	3-Month Euro EURIBOR Future December 2025	10.011	0,00
624	3-Month Euro EURIBOR Future December 2026	1.191.341	0,07
300	3-Month Euro EURIBOR Call Option on Future February 2024, Strike Price EUR 97.50	1.762	0,00
349	3-Month Euro EURIBOR Future June 2024	419.675	0,03
45	3-Month Euro EURIBOR Future June 2025	21.389	0,00
61	3-Month Euro EURIBOR Future June 2026	16.625	0,00
415	3-Month Euro EURIBOR Future March 2024	127.876	0,01
(4.500)	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future March 2024, Strike Price EUR 96.13	305.903	0,02
31	3-Month Euro EURIBOR Future March 2025	24.123	0,00
46	3-Month Euro EURIBOR Future March 2026	9.624	0,00
91	3-Month Euro EURIBOR Future September 2024	6.639	0,00
34	3-Month Euro EURIBOR Future September 2025	11.599	0,00
90	90-Day Bank Bill Future December 2024	88.712	0,01
335	90-Day Bank Bill Future June 2024	204.148	0,01
1.469	90-Day Bank Bill Future March 2024	491.202	0,03
32	90-Day Bank Bill Future March 2025	35.419	0,00
2	90-Day Bank Bill Future September 2024	924	0,00
2.008	Australian Dollar Currency Future March 2024	755.052	0,05
206	Australian Government Bond 10-Year Future March 2024	383.246	0,02
42	Bankers Acceptance Future December 2024	11.755	0,00
438	Bankers Acceptance Future June 2024	180	0,00
16	Bankers Acceptance Future March 2025	4.664	0,00
672	Bankers Acceptance Future September 2024	174.882	0,01
51	Canadian 10-Year Bond Future March 2024	27.628	0,00
(23)	CBOE VIX Index Future February 2024	18.516	0,00
(95)	CBOE VIX Index Future January 2024	103.636	0,01

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,30 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
2	Chinese Yuan Renminbi Currecny Future March 2024	289	0,00
(9)	DAX Index Future March 2024	6.609	0,00
8	DJIA Micro E-mini Future March 2024	5.444	0,00
61	DJIA Mini E-CBOT Future March 2024	392.266	0,02
(2)	Dollar Index Future March 2024	2.022	0,00
1	E-mini Consumer Discretionary Future March 2024	5.570	0,00
5	E-mini Industrial Future March 2024	15.500	0,00
1	E-mini Materials Future March 2024	700	0,00
60	E-mini Russell 2000 Index Future March 2024	50.983	0,00
2	E-mini Technology Future March 2024	7.970	0,00
(225)	Euro Bund Call Option on Future February 2024, Strike Price EUR 140.00	35.593	0,00
(225)	Euro Bund Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 134.00	26.706	0,00
3	Euro Currency Future March 2024	209	0,00
15	Euro FX Currency Future March 2024	9.850	0,00
555	Euro Stoxx 50 Dividend Index Call Option on Future December 2024, Strike Price EUR 160.00	15.479	0,00
(339)	Euro Stoxx 50 Future March 2024	44.827	0,00
5	Euro Stoxx 50 Index Dividend Future December 2024	2.077	0,00
(49)	Euro STOXX Bank Index Future March 2024	3.518	0,00
55	Euro STOXX Bank Index Future March 2024	17.366	0,00
2	Euro/Japanese Yen Currency Future March 2024	1.312	0,00
1.575	Euro-BOBL Future March 2024	996.339	0,06
467	Euro-BTP Future March 2024	101.639	0,01
(635)	Euro-Bund Future March 2024	110.540	0,01
75	Euro-Buxl 30-Year Bond Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 140.00	73.753	0,01
79	Euro-Buxl 30-Year Bond Future March 2024	205.023	0,01
196	Euro-OAT Future March 2024	9.831	0,00
928	Euro-Schatz Future March 2024	284.862	0,02
857	FTSE 100 Index Future March 2024	652.719	0,04
5	FTSE/JSE Top 40 Index Future March 2024	154	0,00
766	Hang Seng China Enterprises Index Future January 2024	1.260.567	0,08
(9)	Indian Rupee Currency Future January 2024	0	0,00
180	Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future March 2024	567.563	0,04
446	Japanese Yen Currency Future March 2024	75.234	0,01
30	KOSPI 200 Index Future March 2024	44.355	0,00
22	Mexican Peso Currency Future March 2024	13.540	0,00
19	Mini- TOPIX Index Future March 2024	1.376	0,00
49	MSCI EAFE Index Future March 2024	165.180	0,01
13	MSCI Emerging Markets Index Future March 2024	7.345	0,00
6	NASD 100 Micro E-mini Future March 2024	6.006	0,00
111	Nasdaq 100 E-mini Future March 2024	403.897	0,02

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,30 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
6	New Zealand Dollar Currency Future March 2024	2.610	0,00
9	Nikkei 225 (CME) Future March 2024	11.600	0,00
13	Nikkei 225 (SGX) Future March 2024	19.908	0,00
337	Nikkei 225 Mini Future March 2024	80.841	0,01
2	NYSE FANG+ Index Future March 2024	1.512	0,00
192	OMXS30 Index Future January 2024	86.840	0,01
748	POSCO Holidings Inc Future January 2024	364.523	0,02
538	S&P 500 E-mini Future March 2024	1.657.989	0,10
15	S&P 500 Micro E-mini Future March 2024	246	0,00
12	S&P E-mini S&P MidCap 400 Future March 2024	17.290	0,00
39	S&P/TSX 60 Index Future March 2024	113.152	0,01
81	SGX FTSE Taiwan Future January 2024	50.630	0,00
448	Short-Term Euro-BTP Future March 2024	27.583	0,00
5.546	SK Hynix Inc Future January 2024	577.121	0,04
17	South African Rand Currency (CME) Future March 2024	17.723	0,00
71	SPI 200 Index Future March 2024	123.386	0,01
110	Swiss Franc Currency Future March 2024	87.330	0,01
34	TOPIX Index Future March 2024	51.780	0,00
147	Turkish Lira Currency Future February 2024	639	0,00
4	United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Future March 2024	478	0,00
26	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	24.562	0,00
12	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024	6.156	0,00
2.862	US Treasury 5-Year Note (CBT) Future March 2024	1.140.680	0,07
(777)	US Treasury Long Bond (CBT) Future March 2024	144.408	0,01
4	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	5.875	0,00
(2)	VSTOXX Future January 2024	39	0,00
26	Yen Denominated Nikkei Future March 2024	32.900	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Futures-Kontrakten ±		**18.420.818**	**1,13**

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Kaufoptionen				
35	21.06.2024	AbbVie Inc, Strike Price $165.00 ±	16.363	0,00
24	19.01.2024	AbbVie Inc, Strike Price $170.00 ±	48	0,00
26	19.01.2024	AbbVie Inc, Strike Price $175.00 ±	273	0,00
29	21.06.2024	AbbVie Inc, Strike Price $180.00 ±	3.698	0,00
24	19.01.2024	AbbVie Inc, Strike Price $190.00 ±	24	0,00
2.500.000 USD	19.01.2024	Absolute Dispersion Basket, Strike Price 17.00% ∞	65	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufsoptionen (Fortsetzung)				
4.000.000 USD	15.03.2024	Absolute Dispersion Basket, Strike Price 17.00% ∞	532	0,00
5.000.000 USD	20.12.2024	Absolute Dispersion Basket, Strike Price 28.00% ∞	24.630	0,00
7.500.000 EUR	28.03.2024	Absolute Dispersion Basket, Strike Price 20.00% ∞	1.682	0,00
1.000.000 EUR	20.12.2024	Absolute Dispersion Basket, Strike Price 32.00% ∞	8.244	0,00
10	19.01.2024	Adobe Inc, Strike Price $410.00 ±	188.150	0,01
9	19.01.2024	Adobe Inc, Strike Price $450.00 ±	133.560	0,01
20.806	09.09.2024	Advanced Energy Industries Inc, Strike Price $111.45 ∞	262.437	0,02
130.036	14.03.2029	Advanced Energy Industries Inc, Strike Price $179.76 ∞	3.123.000	0,19
29	21.06.2024	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price $115.00 ±	114.695	0,01
25	21.06.2024	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price $125.00 ±	81.250	0,01
23	19.01.2024	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price $130.00 ±	42.377	0,00
40	21.06.2024	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price $135.00 ±	103.100	0,01
46	19.01.2024	AeroVironment Inc, Strike Price $105.00 ±	99.820	0,01
38	19.01.2024	AeroVironment Inc, Strike Price $115.00 ±	47.690	0,00
500.000.000 JPY	22.04.2027	Aica Kogyo Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. ∞	439.477	0,03
20.000.000 JPY	26.04.2027	Aica Kogyo Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 70bps. ∞	18.059	0,00
53.892	15.08.2025	Akamai Technologies Inc, Strike Price $104.07 ∞	1.543.899	0,10
33.950	21.08.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price $109.08 ∞	591.491	0,04
125.000	15.08.2025	Akamai Technologies Inc, Strike Price $150.00 ∞	747.732	0,05
121.230	21.06.2029	Akamai Technologies Inc, Strike Price $180.44 ∞	2.084.053	0,13
11	19.01.2024	Align Technology Inc, Strike Price $310.00 ±	1.402	0,00
10	19.01.2024	Align Technology Inc, Strike Price $340.00 ±	2.350	0,00
16	21.06.2024	Ameriprise Financial Inc, Strike Price $360.00 ±	62.480	0,01
19	21.06.2024	Ameriprise Financial Inc, Strike Price $380.00 ±	51.585	0,00
13	21.06.2024	Ameriprise Financial Inc, Strike Price $390.00 ±	28.665	0,00
15	21.06.2024	Ameriprise Financial Inc, Strike Price $420.00 ±	15.675	0,00
900.000.000 JPY	05.09.2024	Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 52bps. ∞	0	0,00
170.000.000 JPY	20.08.2024	Anair, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 55bps. ∞	0	0,00
27	19.01.2024	Analog Devices Inc, Strike Price $210.00 ±	1.282	0,00
24	19.01.2024	Analog Devices Inc, Strike Price $230.00 ±	0	0,00
4.000	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price $40.00 ±	8.280.000	0,51
46.946	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price $42.97 ∞	844.497	0,05
400.000	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price $50.50 ∞	4.900.039	0,31
32	19.01.2024	Apple Inc, Strike Price $175.00 ±	58.880	0,01
94	19.01.2024	Apple Inc, Strike Price $195.00 ±	19.834	0,00
56	19.01.2024	Apple Inc, Strike Price $205.00 ±	1.064	0,00
51	19.01.2024	Applied Materials Inc, Strike Price $130.00 ±	165.622	0,01

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufoptionen (Fortsetzung)				
45	19.01.2024	Applied Materials Inc, Strike Price $145.00 ±	82.012	0,01
23	19.01.2024	Autodesk Inc, Strike Price $230.00 ±	35.190	0,00
21	21.06.2024	Autodesk Inc, Strike Price $230.00 ±	65.205	0,01
25	21.06.2024	Autodesk Inc, Strike Price $240.00 ±	62.500	0,01
11	19.01.2024	Autodesk Inc, Strike Price $250.00 ±	3.080	0,00
18	21.06.2024	Autodesk Inc, Strike Price $250.00 ±	35.280	0,00
18	19.01.2024	Autodesk Inc, Strike Price $260.00 ±	1.530	0,00
10	19.01.2024	Autodesk Inc, Strike Price $270.00 ±	325	0,00
23	19.01.2024	Axon Enterprise Inc, Strike Price $220.00 ±	90.275	0,01
19	19.01.2024	Axon Enterprise Inc, Strike Price $240.00 ±	38.475	0,00
110	19.01.2024	Bath & Body Works Inc, Strike Price $42.50 ±	21.175	0,00
89	19.01.2024	Bath & Body Works Inc, Strike Price $47.50 ±	2.670	0,00
12	21.06.2024	Berkshire Hathaway Inc, Strike Price $380.00 ±	9.300	0,00
12	21.06.2024	Berkshire Hathaway Inc, Strike Price $410.00 ±	2.502	0,00
26	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $105.00 ±	78	0,00
48	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $80.00 ±	5.376	0,00
58	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $85.00 ±	928	0,00
44	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $87.50 ±	264	0,00
87	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $90.00 ±	435	0,00
50	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $92.50 ±	0	0,00
77	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $95.00 ±	154	0,00
75	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $97.50 ±	2.625	0,00
9	26.01.2024	Bill Holdings Inc, Strike Price $71.00 ±	10.620	0,00
9	21.06.2024	BlackRock Inc, Strike Price $820.00 ±	46.530	0,00
61	17.01.2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price $70.00 ±	27.755	0,00
67	19.01.2024	Boyd Gaming Corp, Strike Price $75.00 ±	0	0,00
59	19.01.2024	Boyd Gaming Corp, Strike Price $80.00 ±	0	0,00
47	17.01.2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price $80.00 ±	8.460	0,00
474.110	19.02.2027	BridgeBio Pharma Inc, Strike Price $38.73 ∞	8.266.044	0,51
1.575.000	15.01.2027	BridgeBio Pharma Inc, Strike Price $62.12 ∞	15.327.157	0,94
1.575.000	19.02.2027	BridgeBio Pharma Inc, Strike Price $62.12 ∞	15.768.873	0,97
5	19.01.2024	Broadcom Inc, Strike Price $760.00 ±	179.525	0,01
77	19.01.2024	Cardinal Health Inc, Strike Price $115.00 ±	0	0,00
63	19.01.2024	Cardinal Health Inc, Strike Price $95.00 ±	41.580	0,00
43	17.01.2025	CarMax Inc, Strike Price $90.00 ±	38.270	0,00
37	17.01.2025	CarMax Inc, Strike Price $97.50 ±	24.235	0,00
28	21.06.2024	CDW Corp, Strike Price $230.00 ±	35.280	0,00
29	21.06.2024	CDW Corp, Strike Price $240.00 ±	22.910	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufsoptionen (Fortsetzung)				
25	21.06.2024	CDW Corp, Strike Price $260.00 ±	6.063	0,00
32	19.01.2024	Cencora Inc, Strike Price $195.00 ±	38.720	0,00
27	19.01.2024	Cencora Inc, Strike Price $210.00 ±	3.375	0,00
41	19.01.2024	Cencora Inc, Strike Price $230.00 ±	0	0,00
126.665	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price $105.13 ∞	1.415	0,00
450.000	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price $133.33 ∞	1.144	0,00
1.800	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price $85.00 ±	0	0,00
60	17.01.2025	Charles Schwab Corp, Strike Price $65.00 ±	69.000	0,01
52	17.01.2025	Charles Schwab Corp, Strike Price $70.00 ±	48.100	0,00
182	19.01.2024	Chemours Co, Strike Price $31.00 ±	24.570	0,00
106	17.01.2025	Chemours Co, Strike Price $35.00 ±	38.690	0,00
95	17.01.2025	Chemours Co, Strike Price $37.00 ±	28.500	0,00
4	21.06.2024	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price $2,030.00 ±	145.540	0,01
3	21.06.2024	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price $2,200.00 ±	73.500	0,01
4	19.01.2024	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price $2,250.00 ±	25.340	0,00
3	19.01.2024	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price $2,460.00 ±	802	0,00
390	21.06.2024	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price $17.00 ±	178.425	0,01
410	21.06.2024	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price $20.00 ±	110.085	0,01
116	19.01.2024	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price $22.00 ±	1.972	0,00
103	19.01.2024	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price $25.00 ±	309	0,00
130	19.01.2024	Commercial Metals Co, Strike Price $60.00 ±	1.690	0,00
111	19.01.2024	Commercial Metals Co, Strike Price $65.00 ±	0	0,00
117.000	20.11.2026	Confluent Inc, Strike Price $138.02 ∞	42.974	0,00
117.000	18.12.2026	Confluent Inc, Strike Price $138.02 ∞	47.249	0,00
116.000	15.01.2027	Confluent Inc, Strike Price $138.02 ∞	51.949	0,00
1.500	19.01.2024	Confluent Inc, Strike Price $20.00 ±	540.000	0,03
1.000	19.01.2024	Confluent Inc, Strike Price $50.00 ±	2.000	0,00
11.700	20.11.2026	Confluent Inc, Strike Price $76.14 ∞	23.913	0,00
11.700	18.12.2026	Confluent Inc, Strike Price $76.28 ∞	25.126	0,00
11.600	15.01.2027	Confluent Inc, Strike Price $76.41 ∞	26.133	0,00
60.469	15.01.2027	Conmed Corp, Strike Price $110.88 ∞	1.878.078	0,12
10.078	19.01.2027	Conmed Corp, Strike Price $110.88 ∞	313.667	0,02
210.000	15.01.2027	Conmed Corp, Strike Price $249.05 ∞	999.182	0,06
439	19.01.2024	Coty Inc, Strike Price $13.00 ±	5.487	0,00
408	19.01.2024	Coty Inc, Strike Price $14.00 ±	1.428	0,00
28	19.01.2024	CVS Caremark Corp, Strike Price $105.00 ±	28	0,00
30	19.01.2024	CVS Caremark Corp, Strike Price $97.50 ±	45	0,00
1.130.000.000 JPY	16.11.2029	Cybag, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 170bps. ∞	378.119	0,02

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufsoptionen (Fortsetzung)				
800.000.000 JPY	13.09.2030	Daifuku Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 103bps. ∞	888.767	0,06
40.000.000 JPY	13.09.2030	Daifuku Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 75bps. ∞	19.003	0,00
120	21.06.2024	Dave & Buster's Entertainment Inc, Strike Price $40.00 ±	191.400	0,01
2.173.493	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.13 ∞	3.688.974	0,23
2.173.493	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.13 ∞	4.121.849	0,26
2.173.493	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.97 ∞	2.643.435	0,17
2.173.493	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR21.97 ∞	3.070.171	0,19
102	21.06.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $50.00 ±	23.715	0,00
59	21.06.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $55.00 ±	6.932	0,00
188	19.01.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $60.00 ±	658	0,00
48	21.06.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $60.00 ±	2.352	0,00
128	19.01.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $65.00 ±	192	0,00
35	19.01.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $75.00 ±	35	0,00
35	19.01.2024	Dexcom Inc, Strike Price $140.00 ±	2.187	0,00
52	19.01.2024	Dexcom Inc, Strike Price $145.00 ±	1.560	0,00
28	19.01.2024	Dexcom Inc, Strike Price $152.50 ±	350	0,00
44	19.01.2024	Dexcom Inc, Strike Price $157.50 ±	990	0,00
25	21.06.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $125.00 ±	72.625	0,01
26	19.01.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $135.00 ±	34.190	0,00
21	21.06.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $135.00 ±	46.515	0,00
37	21.06.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $140.00 ±	70.670	0,01
71	19.01.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $150.00 ±	18.637	0,00
70	19.01.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $165.00 ±	1.575	0,00
23	19.01.2024	Dollar Tree Inc, Strike Price $170.00 ±	0	0,00
20	19.01.2024	Dollar Tree Inc, Strike Price $185.00 ±	0	0,00
19	19.01.2024	Domino's Pizza Inc, Strike Price $340.00 ±	139.555	0,01
1.000.000 EUR	15.03.2024	Dual digital option: Euro Stoxx 50 and EUR/USD spot rate, Down and In Strike Price EUR 4,200.00 and 1.04 ∞	7.649	0,00
1.140.000 EUR	15.03.2024	Dual digital option: Euro Stoxx 50 and EUR/USD spot rate, Down and In Strike Price EUR 4,346.20 and 1.05 ∞	22.287	0,00
1.400.000 USD	19.12.2025	Dual digital option: Euro Stoxx 50 and Euro Stoxx 50 Index Dividend, Strike Price EUR155.00 ∞	320.022	0,02
1.000.000 USD	19.01.2024	Dual digital option: S&P 500 Index and SOFR rate, Down and In Strike Price $4.40 ∞	817	0,00
2.400.000 USD	19.01.2024	Dual digital option: S&P 500 Index and SOFR rate, Down and In Strike Price $4.40 ∞	25.663	0,00
1.350.000 USD	17.05.2024	Dual digital option: S&P 500 Index and USD 2 Year SOFR ICE swap rate, Down and In Strike Price $4,100.00 and 3.76% ∞	38.615	0,00
5.000	15.09.2025	Energizer Holdings Inc, Strike Price EUR13.22 ∞	1.348.132	0,08
103.656	30.10.2024	Enovis Corp, Strike Price $47.45 ∞	1.431.793	0,09
334.375	29.08.2028	Enovis Corp, Strike Price $89.72 ∞	3.617.196	0,22
110.000	17.09.2027	Envestnet Inc, Strike Price $110.74 ∞	659.936	0,04

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufsoptionen (Fortsetzung)				
110.000	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price $110.74 ∞	680.043	0,04
110.000	19.11.2027	Envestnet Inc, Strike Price $110.74 ∞	705.189	0,04
92.400	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price $72.69 ∞	947.430	0,06
64	21.06.2024	EQT Corp, Strike Price $50.00 ±	5.504	0,00
53	21.06.2024	EQT Corp, Strike Price $55.00 ±	2.650	0,00
58	19.01.2024	Etsy Inc, Strike Price $100.00 ±	812	0,00
60	19.01.2024	Etsy Inc, Strike Price $95.00 ±	2.010	0,00
340	19.01.2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,525.00 ±	175.021	0,01
13	19.01.2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,550.00 ±	4.968	0,00
18	19.01.2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,575.00 ±	4.951	0,00
106.500.000 EUR	04.01.2024	Euro/Swiss Franc Currency Option, Strike Price 0.97 ∞	25	0,00
4	21.06.2024	Fair Isaac Corp, Strike Price $1,020.00 ±	84.140	0,01
5	21.06.2024	Fair Isaac Corp, Strike Price $940.00 ±	135.425	0,01
200.000.000 JPY	18.03.2024	Fancl Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. ∞	0	0,00
16	19.01.2024	FedEx Corp, Strike Price $240.00 ±	23.160	0,00
25	19.01.2024	FedEx Corp, Strike Price $250.00 ±	16.937	0,00
15	19.01.2024	FedEx Corp, Strike Price $260.00 ±	3.270	0,00
19	21.06.2024	FedEx Corp, Strike Price $280.00 ±	14.725	0,00
15	17.01.2025	FedEx Corp, Strike Price $280.00 ±	28.725	0,00
12	21.06.2024	FedEx Corp, Strike Price $290.00 ±	6.330	0,00
15	17.01.2025	FedEx Corp, Strike Price $300.00 ±	19.125	0,00
17	21.06.2024	FedEx Corp, Strike Price $310.00 ±	3.944	0,00
12	21.06.2024	FedEx Corp, Strike Price $320.00 ±	1.740	0,00
173.640	09.08.2024	Fluor Corp, Strike Price $36.19 ∞	1.158.337	0,07
300.000	15.06.2029	Fluor Corp, Strike Price $68.50 ∞	2.571.255	0,16
300.000	13.07.2029	Fluor Corp, Strike Price $68.50 ∞	2.612.845	0,16
300.000	13.08.2029	Fluor Corp, Strike Price $68.50 ∞	2.659.261	0,16
52	19.01.2024	Foot Locker Inc, Strike Price $50.00 ±	52	0,00
47	19.01.2024	Foot Locker Inc, Strike Price $55.00 ±	0	0,00
46	19.01.2024	Fortinet Inc, Strike Price $75.00 ±	368	0,00
39	19.01.2024	Fortinet Inc, Strike Price $82.00 ±	0	0,00
136	21.06.2024	Freeport-McMoRan Inc, Strike Price $40.00 ±	78.540	0,01
800.000.000 JPY	08.06.2026	GMO Payment Gateway Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 70bps. ∞	24.267	0,00
1.045	15.03.2024	GSK Plc, Strike Price GBP1,520.00 ±	392.989	0,03
29.267	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price $107.62 ∞	1	0,00
200.000	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price $126.14 ∞	7	0,00
68	21.06.2024	Halliburton Co, Strike Price $47.00 ±	3.740	0,00
59	21.06.2024	Halliburton Co, Strike Price $50.00 ±	1.829	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fällig-keit	Art	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Kaufsoptionen (Fortsetzung)				
3.000	15.03.2024	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,200.00 ±	2.554.892	0,16
1.210	19.01.2024	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,300.00 ±	139.463	0,01
467	19.01.2024	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,400.00 ±	35.884	0,00
260	19.01.2024	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,500.00 ±	13.319	0,00
6	19.01.2024	Hang Seng Index Future, Strike Price HKD17,000.00 ±	15.944	0,00
835	19.01.2024	Hang Seng Index Future, Strike Price HKD18,400.00 ±	261.988	0,02
27	19.01.2024	Hess Corp, Strike Price $140.00 ±	19.980	0,00
25	19.01.2024	Hess Corp, Strike Price $150.00 ±	6.250	0,00
600.000.000 JPY	05.09.2024	Hosele Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 75bps. ∞	29.019	0,00
105	19.01.2024	HP Inc, Strike Price $34.00 ±	105	0,00
88	19.01.2024	HP Inc, Strike Price $37.00 ±	88	0,00
148	15.03.2024	Insulet Corp, Strike Price $190.00 ±	534.280	0,03
10.659	17.07.2026	Insulet Corp, Strike Price $321.48 ∞	360.362	0,02
50.000	17.07.2026	Insulet Corp, Strike Price $335.00 ∞	1.529.112	0,10
350.000.000 JPY	28.09.2028	JAFCO Group Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 167bps. ∞	280.040	0,02
1.150.000.000 JPY	28.09.2028	JFE Holdings Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 90bps. ∞	727.233	0,05
61	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $50.00 ±	244	0,00
260	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $55.00 ±	520	0,00
73	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $60.00 ±	292	0,00
7	19.01.2024	Lam Research Corp, Strike Price $550.00 ±	164.657	0,01
10	19.01.2024	Lam Research Corp, Strike Price $560.00 ±	225.525	0,02
6	19.01.2024	Lam Research Corp, Strike Price $590.00 ±	117.390	0,01
9	19.01.2024	Lam Research Corp, Strike Price $610.00 ±	158.377	0,01
87	19.01.2024	Las Vegas Sands Corp, Strike Price $60.00 ±	174	0,00
74	19.01.2024	Las Vegas Sands Corp, Strike Price $65.00 ±	148	0,00
64	19.01.2024	Las Vegas Sands Corp, Strike Price $70.00 ±	288	0,00
12.952	15.12.2028	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price $101.56 ∞	416.563	0,03
80.000	15.12.2028	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price $145.00 ∞	1.552.651	0,10
52	19.01.2024	Louisiana-Pacific Corp, Strike Price $65.00 ±	32.760	0,00
45	19.01.2024	Louisiana-Pacific Corp, Strike Price $70.00 ±	11.250	0,00
52	19.01.2024	Louisiana-Pacific Corp, Strike Price $82.50 ±	520	0,00
24	21.06.2024	Lowe's Companies Inc, Strike Price $220.00 ±	41.520	0,00
21	21.06.2024	Lowe's Companies Inc, Strike Price $240.00 ±	16.643	0,00
14	19.01.2024	Lululemon Athletica Inc, Strike Price $410.00 ±	144.445	0,01
12	19.01.2024	Lululemon Athletica Inc, Strike Price $450.00 ±	75.900	0,01
1.768	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $16.00 ±	76.024	0,01
5.652	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $32.50 ±	5.652	0,00
601	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $40.00 ±	0	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufsoptionen (Fortsetzung)				
168.821	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $41.56 ∞	60	0,00
800.000	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $48.73 ∞	133	0,00
214.527	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $56.35 ∞	19	0,00
1.000.000	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $60.00 ∞	68	0,00
49	21.06.2024	LyondellBasell Industries NV, Strike Price $100.00 ±	18.620	0,00
49	19.01.2024	LyondellBasell Industries NV, Strike Price $109.80 ±	1.470	0,00
41	21.06.2024	LyondellBasell Industries NV, Strike Price $110.00 ±	5.330	0,00
54	19.01.2024	LyondellBasell Industries NV, Strike Price $99.80 ±	1.890	0,00
183	21.06.2024	Marathon Oil Corp, Strike Price $28.00 ±	19.032	0,00
1.111	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price $135.00 ±	0	0,00
78.605	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price $148.83 ∞	73	0,00
283.302	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price $192.36 ∞	14	0,00
2.114	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $110.00 ±	0	0,00
76.632	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $125.67 ∞	1	0,00
124.502	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $132.97 ∞	1	0,00
200	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $140.00 ±	0	0,00
1.157	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $145.00 ±	0	0,00
103.560	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $163.96 ∞	1	0,00
240.000	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $171.93 ∞	1	0,00
400.000	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $181.99 ∞	1	0,00
350.000	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $224.97 ∞	0	0,00
2.550	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $40.00 ±	81.600	0,01
530.000.000 JPY	29.01.2025	Menicon Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 50bps. ∞	23.210	0,00
13	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $310.00 ±	85.540	0,01
11	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $340.00 ±	50.792	0,00
14	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $350.00 ±	56.700	0,00
15	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $365.00 ±	49.425	0,00
13	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $380.00 ±	34.418	0,00
106	16.10.2024	Metlife Inc, Strike Price $71.00 ±	40.716	0,00
106	17.10.2024	Metlife Inc, Strike Price $71.00 ±	40.851	0,00
106	18.10.2024	Metlife Inc, Strike Price $71.00 ±	40.996	0,00
52	21.06.2024	Microchip Technology Inc, Strike Price $87.50 ±	51.480	0,00
47	21.06.2024	Microchip Technology Inc, Strike Price $95.00 ±	28.905	0,00
58	19.01.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $67.50 ±	104.835	0,01
52	19.01.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $75.00 ±	57.850	0,01
59	21.06.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $77.50 ±	79.798	0,01
177	21.06.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $85.00 ±	159.300	0,01
50	21.06.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $95.00 ±	24.000	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufsoptionen (Fortsetzung)				
45.713	18.07.2025	Middleby Corp, Strike Price $150.83 ∞	1.096.375	0,07
112.500	18.07.2025	Middleby Corp, Strike Price $210.00 ∞	659.978	0,04
1.020.000.000 JPY	12.11.2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 38bps. ∞	15.922	0,00
1.000.000.000 JPY	11.12.2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 50bps. ∞	20.124	0,00
370.000.000 JPY	27.11.2024	Nagoya, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 60bps. ∞	9.268	0,00
81	19.01.2024	NetApp Inc, Strike Price $95.00 ±	810	0,00
9	21.06.2024	Netflix Inc, Strike Price $440.00 ±	72.540	0,01
6	21.06.2024	Netflix Inc, Strike Price $490.00 ±	31.035	0,00
10	17.01.2025	Netflix Inc, Strike Price $490.00 ±	82.725	0,01
11	21.06.2024	Netflix Inc, Strike Price $520.00 ±	41.690	0,00
7	17.01.2025	Netflix Inc, Strike Price $530.00 ±	45.133	0,00
10	21.06.2024	Netflix Inc, Strike Price $570.00 ±	21.550	0,00
48	21.06.2024	Neurocrine Biosciences Inc, Strike Price $120.00 ±	89.760	0,01
40	21.06.2024	Neurocrine Biosciences Inc, Strike Price $130.00 ±	50.400	0,00
11	12.01.2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY34,000.00 ±	11.704	0,00
23	12.01.2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY34,500.00 ±	9.136	0,00
91	12.01.2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY34,750.00 ±	21.946	0,00
191	12.01.2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY35,000.00 ±	28.451	0,00
11	09.02.2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY35,000.00 ±	15.605	0,00
146	12.01.2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY35,250.00 ±	13.463	0,00
67	12.01.2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY35,500.00 ±	4.277	0,00
1.200.000.000 JPY	04.10.2024	Nippon 24, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 55bps. ∞	2.993.420	0,19
1.200.000.000 JPY	05.10.2026	Nippon 26, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 65bps. ∞	3.070.843	0,19
10.000.000 JPY	04.09.2026	Nippon Steel Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 49bps. ∞	24.656	0,00
33	21.06.2024	Nucor Corp, Strike Price $175.00 ±	47.768	0,00
28	21.06.2024	Nucor Corp, Strike Price $190.00 ±	24.850	0,00
2.986	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price $170.00 ±	31.353	0,00
49.339	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price $220.35 ∞	35	0,00
64.205	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price $222.80 ∞	43	0,00
200.000	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price $258.28 ∞	61	0,00
250.000	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price $260.83 ∞	73	0,00
30	19.01.2024	ON Semiconductor Corp, Strike Price $100.00 ±	360	0,00
446.500	29.06.2029	ON Semiconductor Corp, Strike Price $156.78 ∞	9.231.876	0,57
446.500	06.07.2029	ON Semiconductor Corp, Strike Price $156.78 ∞	9.267.077	0,57
151.810	28.02.2024	ON Semiconductor Corp, Strike Price $82.83 ∞	1.022.622	0,06
36	19.01.2024	ON Semiconductor Corp, Strike Price $90.00 ±	2.880	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufsoptionen (Fortsetzung)				
77	19.01.2024	ONEOK Inc, Strike Price $67.50 ±	27.720	0,00
68	19.01.2024	ONEOK Inc, Strike Price $72.50 ±	2.720	0,00
87	21.06.2024	ONEOK Inc, Strike Price $72.50 ±	26.970	0,00
71	21.06.2024	ONEOK Inc, Strike Price $80.00 ±	7.100	0,00
150.000.000 JPY	14.12.2028	OSG Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 60bps. ∞	88.842	0,01
75.000	21.11.2025	Palo Alto Networks Inc, Strike Price $193.96 ∞	9.711.184	0,60
662	19.01.2024	PG&E Corp, Strike Price $19.00 ±	5.296	0,00
167	19.01.2024	PG&E Corp, Strike Price $20.00 ±	501	0,00
219	17.01.2025	PG&E Corp, Strike Price $20.00 ±	30.441	0,00
508	19.01.2024	PG&E Corp, Strike Price $21.00 ±	0	0,00
25	19.01.2024	Pioneer Natural Resources Co, Strike Price $250.00 ±	500	0,00
23	19.01.2024	Pioneer Natural Resources Co, Strike Price $270.00 ±	230	0,00
122	17.07.2024	POSCO Holdings Inc, Strike Price KRW488,000.00 ∞	5.699	0,00
55	21.06.2024	Prudential Financial Inc, Strike Price $105.00 ±	30.525	0,00
57	19.01.2024	Qorvo Inc, Strike Price $125.00 ±	798	0,00
37	21.06.2024	Ralph Lauren Corp, Strike Price $125.00 ±	95.460	0,01
35	21.06.2024	Ralph Lauren Corp, Strike Price $135.00 ±	63.875	0,01
54	19.01.2024	Ralph Lauren Corp, Strike Price $145.00 ±	15.255	0,00
48	19.01.2024	Ralph Lauren Corp, Strike Price $155.00 ±	1.440	0,00
151	19.01.2024	Range Resources Corp, Strike Price $29.00 ±	29.445	0,00
132	19.01.2024	Range Resources Corp, Strike Price $31.00 ±	10.230	0,00
142	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $35.00 ±	24.850	0,00
138	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $37.00 ±	16.905	0,00
77	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $39.00 ±	6.545	0,00
116	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $40.00 ±	8.120	0,00
67	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $42.00 ±	3.350	0,00
23	19.01.2024	RH, Strike Price $280.00 ±	43.240	0,00
17	19.01.2024	RH, Strike Price $300.00 ±	14.280	0,00
11	19.01.2024	RH, Strike Price $310.00 ±	5.775	0,00
14	19.01.2024	RH, Strike Price $330.00 ±	2.765	0,00
10	21.06.2024	RH, Strike Price $390.00 ±	11.500	0,00
9	21.06.2024	RH, Strike Price $420.00 ±	6.750	0,00
701	15.03.2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price $4,350.00 ±	17.016.775	1,05
1	19.01.2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price $4,650.00 ±	8.888	0,00
73	19.01.2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price $4,670.00 ±	582.175	0,04
106	19.01.2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price $4,780.00 ±	373.650	0,02
2	19.01.2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price $4,830.00 ±	4.100	0,00
360	31.01.2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price $4,950.00 ±	252.000	0,02

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufsoptionen (Fortsetzung)				
23	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,425.00 ±	833.865	0,06
1	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,740.00 ±	7.310	0,00
1	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,770.00 ±	5.360	0,00
64	16.02.2024	S&P 500 Index, Strike Price $5,150.00 ±	11.680	0,00
64	16.02.2024	S&P 500 Index, Strike Price $5,500.00 ±	1.120	0,00
202	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price $70.00 ±	543.380	0,03
4.000	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price $75.00 ±	8.780.000	0,54
48.561	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price $82.73 ∞	723.522	0,04
400.000	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price $96.97 ∞	2.092.308	0,13
1.150.000.000 JPY	25.07.2025	SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 110bps. ∞	1.525.114	0,10
1.200.000.000 JPY	11.07.2025	SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 148bps. ∞	1.636.795	0,10
1.000.000.000 JPY	25.07.2025	SBI Group, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 148bps. ∞	1.368.065	0,09
216.740	01.05.2028	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price $107.85 ∞	3.269.921	0,20
36.846	09.09.2024	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price $64.30 ∞	896.473	0,06
58.277	21.01.2028	Semtech Corp, Strike Price $41.74 ∞	368.205	0,02
400.000	21.01.2028	Semtech Corp, Strike Price $51.00 ∞	2.136.019	0,13
11	19.01.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $480.00 ±	251.625	0,02
10	19.01.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $530.00 ±	177.850	0,01
11	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $620.00 ±	137.390	0,01
9	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $680.00 ±	76.995	0,01
18	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $740.00 ±	97.830	0,01
9	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $800.00 ±	27.900	0,00
24	19.01.2024	Sherwin-Williams Co, Strike Price $260.00 ±	126.960	0,01
22	19.01.2024	Sherwin-Williams Co, Strike Price $280.00 ±	72.600	0,01
1.050	21.06.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $120.40 ∞	25.039	0,00
1.050	19.07.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $120.40 ∞	38.654	0,00
1.050	16.08.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $120.40 ∞	55.661	0,00
1.465	16.02.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $80.00 ±	476.125	0,03
4.610	20.12.2024	Siemens Energy AG, Strike Price EUR13.00 ±	903.907	0,06
38	21.06.2024	Signet Jewelers Ltd, Strike Price $85.00 ±	106.970	0,01
33	21.06.2024	Signet Jewelers Ltd, Strike Price $90.00 ±	81.015	0,01
45	21.06.2024	Simon Property Group Inc, Strike Price $135.00 ±	64.575	0,01
40	21.06.2024	Simon Property Group Inc, Strike Price $145.00 ±	34.600	0,00
49.453	11.01.2024	SK Hynix Inc, Strike Price KRW88,200.00 ∞	2.049.762	0,13
113	19.01.2024	Skechers USA Inc, Strike Price $60.00 ±	35.030	0,00
65	19.01.2024	Skyworks Solutions Inc, Strike Price $120.00 ±	2.437	0,00
96	19.01.2024	Skyworks Solutions Inc, Strike Price $130.00 ±	960	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufsoptionen (Fortsetzung)				
37	19.01.2024	Skyworks Solutions Inc, Strike Price $140.00 ±	185	0,00
894.454	28.02.2030	Stem Inc, Strike Price $11.18 ∞	1.740.099	0,11
89.445	01.04.2024	Stem Inc, Strike Price $5.87 ∞	21.669	0,00
734	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price $30.00 ±	5.505	0,00
67.492	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price $37.85 ∞	465	0,00
400.000	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price $48.06 ∞	893	0,00
50	19.01.2024	T Rowe Price Group Inc, Strike Price $120.00 ±	500	0,00
34	17.01.2025	T Rowe Price Group Inc, Strike Price $120.00 ±	23.970	0,00
28	17.01.2025	T Rowe Price Group Inc, Strike Price $130.00 ±	11.340	0,00
44	19.01.2024	T Rowe Price Group Inc, Strike Price $135.00 ±	0	0,00
34	17.01.2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD18,200.00 ±	4.598	0,00
1.280.000.000 JPY	19.09.2030	Taiyo Yuden Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 70bps. ∞	1.423.181	0,09
32	21.06.2024	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price $155.00 ±	57.520	0,00
20	19.01.2024	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price $165.00 ±	3.510	0,00
26	21.06.2024	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price $170.00 ±	27.170	0,00
42	19.01.2024	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price $180.00 ±	504	0,00
217	19.01.2024	Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price $24.00 ±	82.460	0,01
185	19.01.2024	Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price $26.00 ±	37.462	0,00
77	19.01.2024	Targa Resources Corp, Strike Price $77.50 ±	73.150	0,01
55	21.06.2024	TD SYNNEX Corp, Strike Price $110.00 ±	39.600	0,00
120	19.01.2024	Tenet Healthcare Corp, Strike Price $75.00 ±	34.200	0,00
34	19.01.2024	Tenet Healthcare Corp, Strike Price $85.00 ±	850	0,00
14	21.06.2024	Tesla Motors Inc, Strike Price $240.00 ±	55.755	0,00
13	21.06.2024	Tesla Motors Inc, Strike Price $260.00 ±	39.357	0,00
34.900	19.08.2024	Tetra Tech Inc, Strike Price $165.63 ∞	616.297	0,04
127.138	17.07.2028	Tetra Tech Inc, Strike Price $259.56 ∞	2.379.231	0,15
28	19.01.2024	Texas Instruments Inc, Strike Price $200.00 ±	112	0,00
26	19.01.2024	Texas Instruments Inc, Strike Price $220.00 ±	130	0,00
49	21.06.2024	Thor Industries Inc, Strike Price $115.00 ±	68.600	0,01
42	21.06.2024	Thor Industries Inc, Strike Price $125.00 ±	38.430	0,00
480.000	21.06.2024	T-Mobile US Inc, Strike Price $160.95 ∞	4.465.873	0,28
540.000.000 JPY	13.09.2030	Tokyu Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 100bps. ∞	224.826	0,02
230.000.000 JPY	29.09.2028	Tokyu Corp, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 85bps. ∞	101.077	0,01
23	19.01.2024	Tractor Supply Co, Strike Price $250.00 ±	460	0,00
20	19.01.2024	Tractor Supply Co, Strike Price $280.00 ±	0	0,00
1.000.000.000 JPY	13.11.2026	Transcosmos Inc, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 45bps. ∞	149.476	0,01
7	19.01.2024	Ulta Beauty Inc, Strike Price $580.00 ±	119	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufoptionen (Fortsetzung)				
11	19.01.2024	Ulta Beauty Inc, Strike Price $600.00 ±	110	0,00
7	19.01.2024	Ulta Beauty Inc, Strike Price $620.00 ±	0	0,00
9	19.01.2024	Ulta Beauty Inc, Strike Price $660.00 ±	90	0,00
150.000.000 USD	18.04.2024	United States Dollar/Hong Kong Dollar Currency Option, Strike Price 7.85 ∞	45.900	0,00
120	19.01.2024	United States Steel Corp, Strike Price $24.00 ±	298.800	0,02
104	19.01.2024	United States Steel Corp, Strike Price $26.00 ±	238.160	0,02
29	21.06.2024	Universal Display Corp, Strike Price $185.00 ±	72.355	0,01
1.035	26.01.2024	US Treasury 10-Year Note Call Option on Futures, Strike Price $114.00 ±	501.328	0,03
1.803	21.06.2024	Variance on the S&P 500 Index, Strike Price 30% ∞	23.501	0,00
78	21.06.2024	Voya Financial Inc, Strike Price $77.50 ±	20.670	0,00
29	19.01.2024	Walmart Inc, Strike Price $160.00 ±	3.857	0,00
27	19.01.2024	Walmart Inc, Strike Price $175.00 ±	121	0,00
513	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $195.00 ±	19.237	0,00
41.564	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $210.42 ∞	5	0,00
37.717	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $252.89 ∞	1	0,00
49.550	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $253.24 ∞	0	0,00
20.000	09.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $267.94 ∞	0	0,00
160.000	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $267.94 ∞	4	0,00
160.000	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $322.19 ∞	1	0,00
200.000	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $323.74 ∞	2	0,00
114.629	13.05.2024	Wayfair Inc, Strike Price $38.47 ∞	2.947.678	0,18
818.777	25.10.2028	Wayfair Inc, Strike Price $73.28 ∞	27.918.544	1,72
10	21.06.2024	West Pharmaceutical Services Inc, Strike Price $430.00 ±	6.150	0,00
9	21.06.2024	West Pharmaceutical Services Inc, Strike Price $470.00 ±	2.182	0,00
41.096	07.11.2024	Western Digital Corp, Strike Price $42.46 ∞	585.085	0,04
100	21.06.2024	Western Digital Corp, Strike Price $52.50 ±	56.250	0,00
249.066	16.10.2028	Western Digital Corp, Strike Price $70.26 ∞	3.454.494	0,21
22	21.06.2024	Wingstop Inc, Strike Price $250.00 ±	73.590	0,01
19	21.06.2024	Wingstop Inc, Strike Price $280.00 ±	36.670	0,00
87	19.01.2024	Winnebago Industries Inc, Strike Price $65.00 ±	77.865	0,01
49	21.06.2024	Winnebago Industries Inc, Strike Price $65.00 ±	58.065	0,01
81	19.01.2024	Winnebago Industries Inc, Strike Price $70.00 ±	30.375	0,00
41	21.06.2024	Winnebago Industries Inc, Strike Price $70.00 ±	39.975	0,00
21.739	19.10.2029	Wolfspeed Inc, Strike Price $107.31 ∞	401.080	0,03
120.000	19.10.2029	Wolfspeed Inc, Strike Price $200.00 ∞	1.597.042	0,10
46	19.01.2024	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price $110.00 ±	506	0,00
42	19.01.2024	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price $115.00 ±	42	0,00
42	19.01.2024	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price $120.00 ±	294	0,00
73	19.01.2024	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price $130.00 ±	0	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufsoptionen (Fortsetzung)				
170.000.000 JPY	20.06.2024	Yaoko Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: 50bps. ∞	415.652	0,03
500.000.000 JPY	21.05.2024	Yaoko Co Ltd, Asset Swapped Convertible Option, recall spread: TONA plus 55bps. ∞	1.222.165	0,08
Verkaufsoptionen				
50	14.06.2024	3 Month SOFR Put Option on Future, Strike Price $94.00 ±	1.563	0,00
50	14.06.2024	3 Month SOFR Put Option on Future, Strike Price $94.75 ±	4.688	0,00
66	19.01.2024	AbbVie Inc, Strike Price $100.00 ±	0	0,00
81	21.06.2024	AbbVie Inc, Strike Price $105.00 ±	4.212	0,00
42	19.01.2024	AbbVie Inc, Strike Price $110.00 ±	0	0,00
47	19.01.2024	AbbVie Inc, Strike Price $120.00 ±	235	0,00
57	21.06.2024	AbbVie Inc, Strike Price $125.00 ±	8.522	0,00
34	19.01.2024	AbbVie Inc, Strike Price $135.00 ±	357	0,00
41	21.06.2024	AbbVie Inc, Strike Price $150.00 ±	25.318	0,00
29	19.01.2024	AbbVie Inc, Strike Price $160.00 ±	20.227	0,00
102	19.01.2024	AbbVie Inc, Strike Price $80.00 ±	0	0,00
15	19.01.2024	Adobe Inc, Strike Price $260.00 ±	0	0,00
12	19.01.2024	Adobe Inc, Strike Price $320.00 ±	24	0,00
11	19.01.2024	Adobe Inc, Strike Price $370.00 ±	33	0,00
159	19.04.2024	Advanced Energy Industries Inc, Strike Price $80.00 ±	25.440	0,00
98	21.06.2024	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price $105.00 ±	24.451	0,00
45	21.06.2024	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price $125.00 ±	29.700	0,00
105	19.01.2024	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price $60.00 ±	105	0,00
66	21.06.2024	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price $75.00 ±	3.036	0,00
96	21.06.2024	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price $85.00 ±	7.824	0,00
47	21.06.2024	Advanced Micro Devices Inc, Strike Price $90.00 ±	5.100	0,00
77	19.01.2024	AeroVironment Inc, Strike Price $80.00 ±	0	0,00
55	19.01.2024	AeroVironment Inc, Strike Price $95.00 ±	0	0,00
750	19.01.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price $65.00 ±	0	0,00
205	16.02.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price $75.00 ±	2.050	0,00
18	19.01.2024	Align Technology Inc, Strike Price $240.00 ±	1.890	0,00
14.881	19.01.2024	American Airlines Group Inc, Strike Price $10.00 ±	37.202	0,00
4.298	17.05.2024	American Airlines Group Inc, Strike Price $10.00 ±	98.854	0,01
4.815	15.03.2024	American Airlines Group Inc, Strike Price $8.00 ±	57.780	0,00
1.369	16.02.2024	American Airlines Group Inc, Strike Price $9.00 ±	6.845	0,00
7.853	17.05.2024	American Airlines Group Inc, Strike Price $9.00 ±	113.869	0,01
33	21.06.2024	Ameriprise Financial Inc, Strike Price $230.00 ±	1.898	0,00
44	21.06.2024	Ameriprise Financial Inc, Strike Price $240.00 ±	4.620	0,00
24	21.06.2024	Ameriprise Financial Inc, Strike Price $280.00 ±	4.500	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
29	21.06.2024	Ameriprise Financial Inc, Strike Price $300.00 ±	8.918	0,00
19	21.06.2024	Ameriprise Financial Inc, Strike Price $330.00 ±	12.350	0,00
22	21.06.2024	Ameriprise Financial Inc, Strike Price $350.00 ±	24.970	0,00
56.384	20.12.2024	ams AG, Strike Price CHF0.97 ±	3.055.069	0,19
26.654	15.03.2024	ams AG, Strike Price CHF1.50 ±	1.061.045	0,07
43	19.01.2024	Analog Devices Inc, Strike Price $130.00 ±	645	0,00
35	19.01.2024	Analog Devices Inc, Strike Price $160.00 ±	962	0,00
30	19.01.2024	Analog Devices Inc, Strike Price $190.00 ±	3.075	0,00
48	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price $22.50 ±	840	0,00
45	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price $30.00 ±	2.137	0,00
217	19.01.2024	Apple Inc, Strike Price $105.00 ±	217	0,00
48	19.01.2024	Apple Inc, Strike Price $115.00 ±	48	0,00
154	19.01.2024	Apple Inc, Strike Price $125.00 ±	154	0,00
41	19.01.2024	Apple Inc, Strike Price $135.00 ±	82	0,00
105	19.01.2024	Apple Inc, Strike Price $150.00 ±	420	0,00
35	19.01.2024	Apple Inc, Strike Price $160.00 ±	210	0,00
74	19.01.2024	Apple Inc, Strike Price $180.00 ±	2.368	0,00
65	19.01.2024	Applied Materials Inc, Strike Price $100.00 ±	260	0,00
54	19.01.2024	Applied Materials Inc, Strike Price $120.00 ±	324	0,00
79	19.01.2024	Applied Materials Inc, Strike Price $82.50 ±	0	0,00
51	21.06.2024	Autodesk Inc, Strike Price $145.00 ±	4.080	0,00
52	19.01.2024	Autodesk Inc, Strike Price $150.00 ±	0	0,00
60	21.06.2024	Autodesk Inc, Strike Price $150.00 ±	4.950	0,00
17	19.01.2024	Autodesk Inc, Strike Price $160.00 ±	0	0,00
36	19.01.2024	Autodesk Inc, Strike Price $180.00 ±	270	0,00
77	21.06.2024	Autodesk Inc, Strike Price $180.00 ±	18.095	0,00
14	19.01.2024	Autodesk Inc, Strike Price $195.00 ±	245	0,00
27	19.01.2024	Autodesk Inc, Strike Price $210.00 ±	742	0,00
57	21.06.2024	Autodesk Inc, Strike Price $210.00 ±	37.050	0,00
12	19.01.2024	Autodesk Inc, Strike Price $230.00 ±	1.350	0,00
55	19.01.2024	Axon Enterprise Inc, Strike Price $140.00 ±	0	0,00
37	19.01.2024	Axon Enterprise Inc, Strike Price $170.00 ±	185	0,00
28	19.01.2024	Axon Enterprise Inc, Strike Price $200.00 ±	280	0,00
15.416	21.06.2024	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR3.60 ±	17.029	0,00
309	21.06.2024	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR3.90 ±	341	0,00
195	21.06.2024	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR4.50 ±	646	0,00
4.070	21.06.2024	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR4.70 ±	17.984	0,00
4.460	21.06.2024	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR5.00 ±	24.634	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
7.040	20.09.2024	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Strike Price EUR5.25 ±	77.767	0,01
375	21.06.2024	Banco BPM SpA, Strike Price EUR2.20 ±	7.953	0,00
3.255	15.03.2024	Banco BPM SpA, Strike Price EUR2.50 ±	36.675	0,00
30.000	21.06.2024	Banco Santander SA, Strike Price EUR2.60 ±	66.279	0,01
261	19.01.2024	Bath & Body Works Inc, Strike Price $27.50 ±	0	0,00
187	19.01.2024	Bath & Body Works Inc, Strike Price $32.50 ±	4.675	0,00
124	19.01.2024	Bath & Body Works Inc, Strike Price $40.00 ±	5.270	0,00
29	21.06.2024	Berkshire Hathaway Inc, Strike Price $240.00 ±	1.131	0,00
20	21.06.2024	Berkshire Hathaway Inc, Strike Price $290.00 ±	3.340	0,00
14	21.06.2024	Berkshire Hathaway Inc, Strike Price $350.00 ±	12.180	0,00
77	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $50.00 ±	693	0,00
138	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $55.00 ±	414	0,00
45	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $60.00 ±	202	0,00
62	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $62.50 ±	713	0,00
98	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $65.00 ±	490	0,00
88	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $75.00 ±	5.324	0,00
70	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $77.50 ±	9.380	0,00
102	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $82.50 ±	46.155	0,00
31	19.01.2024	Best Buy Co Inc, Strike Price $87.50 ±	28.675	0,00
20	21.06.2024	BlackRock Inc, Strike Price $520.00 ±	4.900	0,00
14	21.06.2024	BlackRock Inc, Strike Price $640.00 ±	8.470	0,00
11	21.06.2024	BlackRock Inc, Strike Price $750.00 ±	26.125	0,00
345	21.06.2024	BNP Paribas SA, Strike Price EUR40.00 ±	13.910	0,00
145	17.01.2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price $45.00 ±	18.488	0,00
96	17.01.2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price $55.00 ±	30.240	0,00
70	17.01.2025	Boyd Gaming Corp, Strike Price $65.00 ±	42.700	0,00
76	19.01.2024	Boyd Gaming Corp, Strike Price $70.00 ±	57.760	0,00
2.202	17.05.2024	Bridgebio Pharma Inc, Strike Price $20.00 ±	115.605	0,01
3.520	16.02.2024	Bridgebio Pharma Inc, Strike Price $22.50 ±	70.400	0,01
9	19.01.2024	Broadcom Inc, Strike Price $440.00 ±	0	0,00
8	19.01.2024	Broadcom Inc, Strike Price $530.00 ±	0	0,00
6	19.01.2024	Broadcom Inc, Strike Price $630.00 ±	30	0,00
159	19.01.2024	Cardinal Health Inc, Strike Price $60.00 ±	0	0,00
236	19.01.2024	Cardinal Health Inc, Strike Price $65.00 ±	0	0,00
103	19.01.2024	Cardinal Health Inc, Strike Price $75.00 ±	0	0,00
75	19.01.2024	Cardinal Health Inc, Strike Price $87.50 ±	1.312	0,00
101	17.01.2025	CarMax Inc, Strike Price $57.50 ±	41.915	0,00
68	17.01.2025	CarMax Inc, Strike Price $70.00 ±	54.060	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
53	17.01.2025	CarMax Inc, Strike Price $80.00 ±	65.720	0,01
4.238	19.04.2024	Carnival Corp, Strike Price $10.00 ±	40.261	0,00
669	19.01.2024	Carnival Corp, Strike Price $11.00 ±	669	0,00
8.640	19.04.2024	Carnival Corp, Strike Price $11.00 ±	60.480	0,01
50	02.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $3,800.00 ±	500	0,00
136	21.06.2024	CDW Corp, Strike Price $150.00 ±	34.680	0,00
43	21.06.2024	CDW Corp, Strike Price $180.00 ±	12.040	0,00
48	21.06.2024	CDW Corp, Strike Price $185.00 ±	12.240	0,00
31	21.06.2024	CDW Corp, Strike Price $210.00 ±	16.120	0,00
34	21.06.2024	CDW Corp, Strike Price $220.00 ±	27.200	0,00
137	15.03.2024	Cellnex Telecom SA, Strike Price EUR25.00 ±	3.935	0,00
235	20.09.2024	Cellnex Telecom SA, Strike Price EUR25.00 ±	21.287	0,00
112	19.01.2024	Cencora Inc, Strike Price $135.00 ±	0	0,00
52	19.01.2024	Cencora Inc, Strike Price $150.00 ±	0	0,00
36	19.01.2024	Cencora Inc, Strike Price $180.00 ±	1.440	0,00
137	17.01.2025	Charles Schwab Corp, Strike Price $42.50 ±	14.865	0,00
100	17.01.2025	Charles Schwab Corp, Strike Price $50.00 ±	21.300	0,00
70	17.01.2025	Charles Schwab Corp, Strike Price $60.00 ±	29.575	0,00
284	19.01.2024	Chemours Co, Strike Price $20.00 ±	0	0,00
245	17.01.2025	Chemours Co, Strike Price $23.00 ±	37.363	0,00
236	19.01.2024	Chemours Co, Strike Price $24.00 ±	0	0,00
203	19.01.2024	Chemours Co, Strike Price $28.00 ±	5.582	0,00
165	17.01.2025	Chemours Co, Strike Price $28.00 ±	49.913	0,00
120	17.01.2025	Chemours Co, Strike Price $33.00 ±	64.800	0,01
9	19.01.2024	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price $1,120.00 ±	117	0,00
6	21.06.2024	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price $1,300.00 ±	795	0,00
6	19.01.2024	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price $1,430.00 ±	0	0,00
7	19.01.2024	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price $1,440.00 ±	0	0,00
4	21.06.2024	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price $1,570.00 ±	3.080	0,00
4	21.06.2024	Chipotle Mexican Grill Inc, Strike Price $1,850.00 ±	11.540	0,00
1.125	21.06.2024	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price $10.00 ±	9.562	0,00
1.328	21.06.2024	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price $13.00 ±	21.912	0,00
171	19.01.2024	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price $15.00 ±	427	0,00
999	21.06.2024	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price $15.00 ±	35.464	0,00
386	21.06.2024	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price $17.00 ±	28.371	0,00
142	19.01.2024	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price $18.00 ±	852	0,00
128	19.01.2024	Cleveland-Cliffs Inc, Strike Price $20.00 ±	5.248	0,00
219	19.01.2024	Commercial Metals Co, Strike Price $46.00 ±	9.307	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
154	19.01.2024	Commercial Metals Co, Strike Price $55.00 ±	82.390	0,01
1.000	17.05.2024	CONMED Corp, Strike Price $80.00 ±	112.500	0,01
571	19.01.2024	Coty Inc, Strike Price $10.00 ±	0	0,00
475	19.01.2024	Coty Inc, Strike Price $12.00 ±	7.362	0,00
714	19.01.2024	Coty Inc, Strike Price $8.00 ±	0	0,00
584	15.03.2024	Crédit Agricole SA, Strike Price EUR6.00 ±	645	0,00
10.567	21.06.2024	Crédit Agricole SA, Strike Price EUR6.00 ±	35.019	0,00
45	19.01.2024	CVS Caremark Corp, Strike Price $65.00 ±	135	0,00
39	19.01.2024	CVS Caremark Corp, Strike Price $75.00 ±	1.579	0,00
310	21.06.2024	Dave & Buster's Entertainment Inc, Strike Price $25.00 ±	12.400	0,00
215	21.06.2024	Dave & Buster's Entertainment Inc, Strike Price $30.00 ±	6.988	0,00
160	21.06.2024	Dave & Buster's Entertainment Inc, Strike Price $35.00 ±	12.400	0,00
593	15.03.2024	Davide Campari-Milano NV, Strike Price EUR8.60 ±	25.482	0,00
16.780	21.06.2024	Deutsche Lufthansa AG, Strike Price EUR5.60 ±	213.164	0,01
1.395.000	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 ∞	243.321	0,01
1.395.000	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 ∞	361.953	0,02
231	19.01.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $27.00 ±	0	0,00
237	21.06.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $32.50 ±	18.368	0,00
143	21.06.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $35.00 ±	13.657	0,00
155	19.01.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $37.00 ±	620	0,00
178	21.06.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $37.50 ±	24.653	0,00
62	19.01.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $42.00 ±	1.519	0,00
96	21.06.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $42.50 ±	27.888	0,00
128	19.01.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $45.00 ±	13.184	0,00
124	21.06.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $45.00 ±	49.910	0,00
209	19.01.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $50.00 ±	105.545	0,01
71	21.06.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $50.00 ±	49.877	0,00
105	19.01.2024	Devon Energy Corp, Strike Price $55.00 ±	101.325	0,01
57	19.01.2024	Dexcom Inc, Strike Price $107.50 ±	2.850	0,00
88	19.01.2024	Dexcom Inc, Strike Price $110.00 ±	6.380	0,00
81	19.01.2024	Dexcom Inc, Strike Price $90.00 ±	2.025	0,00
90	21.06.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $110.00 ±	23.850	0,00
55	19.01.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $115.00 ±	825	0,00
42	21.06.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $130.00 ±	28.980	0,00
62	19.01.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $135.00 ±	3.875	0,00
59	21.06.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $80.00 ±	6.343	0,00
87	21.06.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $90.00 ±	7.830	0,00
79	19.01.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $95.00 ±	395	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
43	21.06.2024	Dick's Sporting Goods Inc, Strike Price $95.00 ±	5.160	0,00
4.500	19.01.2024	DISH Network Corp, Strike Price $3.00 ±	4.500	0,00
1.724	19.01.2024	DISH Network Corp, Strike Price $4.00 ±	9.482	0,00
755	15.03.2024	DISH Network Corp, Strike Price $4.00 ±	20.762	0,00
420	21.06.2024	DISH Network Corp, Strike Price $5.00 ±	40.740	0,00
35	19.01.2024	Dollar Tree Inc, Strike Price $135.00 ±	2.730	0,00
28	19.01.2024	Domino's Pizza Inc, Strike Price $220.00 ±	0	0,00
25	19.01.2024	Domino's Pizza Inc, Strike Price $260.00 ±	0	0,00
21	19.01.2024	Domino's Pizza Inc, Strike Price $310.00 ±	336	0,00
74	19.01.2024	Eagle Materials Inc, Strike Price $120.00 ±	0	0,00
939	19.04.2024	Enovis Corporation, Strike Price $30.00 ±	16.433	0,00
1.665	16.02.2024	Envestnet Inc, Strike Price $35.00 ±	112.387	0,01
378	19.01.2024	EQT Corp, Strike Price $29.00 ±	1.134	0,00
173	21.06.2024	EQT Corp, Strike Price $30.00 ±	15.397	0,00
97	21.06.2024	EQT Corp, Strike Price $40.00 ±	41.468	0,00
77	21.06.2024	EQT Corp, Strike Price $45.00 ±	59.098	0,01
2.670	21.06.2024	Erste Group Bank AG, Strike Price EUR20.00 ±	45.716	0,00
1.115	21.06.2024	Erste Group Bank AG, Strike Price EUR22.00 ±	21.554	0,00
89	19.01.2024	Etsy Inc, Strike Price $65.00 ±	1.246	0,00
72	19.01.2024	Etsy Inc, Strike Price $80.00 ±	19.188	0,00
238	19.01.2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,350.00 ±	22.610	0,00
338	19.01.2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,525.00 ±	185.939	0,01
3.000.000 EUR	18.01.2024	Euro/United States Dollar Currency Option, Strike Price 1.00 ∞	0	0,00
11	21.06.2024	Fair Isaac Corp, Strike Price $600.00 ±	3.135	0,00
6	21.06.2024	Fair Isaac Corp, Strike Price $720.00 ±	3.045	0,00
6	21.06.2024	Fair Isaac Corp, Strike Price $850.00 ±	8.520	0,00
25	19.01.2024	FedEx Corp, Strike Price $155.00 ±	50	0,00
39	19.01.2024	FedEx Corp, Strike Price $160.00 ±	78	0,00
37	17.01.2025	FedEx Corp, Strike Price $175.00 ±	14.615	0,00
44	21.06.2024	FedEx Corp, Strike Price $180.00 ±	4.268	0,00
21	19.01.2024	FedEx Corp, Strike Price $185.00 ±	63	0,00
32	21.06.2024	FedEx Corp, Strike Price $185.00 ±	3.840	0,00
34	19.01.2024	FedEx Corp, Strike Price $190.00 ±	136	0,00
18	19.01.2024	FedEx Corp, Strike Price $220.00 ±	306	0,00
53	21.06.2024	FedEx Corp, Strike Price $220.00 ±	25.837	0,00
24	17.01.2025	FedEx Corp, Strike Price $220.00 ±	28.500	0,00
28	19.01.2024	FedEx Corp, Strike Price $230.00 ±	644	0,00
19	17.01.2025	FedEx Corp, Strike Price $250.00 ±	42.608	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
38	21.06.2024	FedEx Corp, Strike Price $260.00 ±	69.920	0,01
56	19.01.2024	Five Below Inc, Strike Price $135.00 ±	0	0,00
1.125	19.01.2024	Fluor Corp, Strike Price $25.00 ±	0	0,00
80	19.01.2024	Foot Locker Inc, Strike Price $32.50 ±	15.600	0,00
183	19.01.2024	Fortinet Inc, Strike Price $37.00 ±	0	0,00
347	21.06.2024	Freeport-McMoRan Inc, Strike Price $25.00 ±	4.164	0,00
200	21.06.2024	Freeport-McMoRan Inc, Strike Price $33.00 ±	15.200	0,00
152	21.06.2024	Freeport-McMoRan Inc, Strike Price $38.00 ±	28.348	0,00
161	21.06.2024	Halliburton Co, Strike Price $30.00 ±	15.617	0,00
108	21.06.2024	Halliburton Co, Strike Price $37.00 ±	37.260	0,00
83	21.06.2024	Halliburton Co, Strike Price $42.00 ±	55.610	0,00
7.296	15.03.2024	Herbalife Nutrition Ltd, Strike Price $7.50 ±	127.680	0,01
34	19.01.2024	Hess Corp, Strike Price $110.00 ±	0	0,00
30	19.01.2024	Hess Corp, Strike Price $125.00 ±	3.300	0,00
42	19.01.2024	Hess Corp, Strike Price $90.00 ±	0	0,00
81	19.01.2024	Hess Corp, Strike Price $92.50 ±	0	0,00
122	19.01.2024	Hess Corp, Strike Price $97.50 ±	610	0,00
369	19.01.2024	HP Inc, Strike Price $18.00 ±	0	0,00
4.432	15.03.2024	Idorsia Ltd, Strike Price CHF1.40 ±	210.634	0,01
10.248	15.03.2024	Idorsia Ltd, Strike Price CHF1.80 ±	657.508	0,04
6.133	15.03.2024	Idorsia Ltd, Strike Price CHF2.20 ±	546.516	0,04
165	19.01.2024	Insulet Corp, Strike Price $130.00 ±	31.350	0,00
200	15.03.2024	InterDigital Inc, Strike Price $55.00 ±	0	0,00
5.360	15.03.2024	International Consolidated Airlines Group SA, Strike Price GBP100.00 ±	17.082	0,00
240	21.06.2024	Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1.00 ±	2.174	0,00
400	21.06.2024	Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1.20 ±	3.977	0,00
16.954	21.06.2024	Intesa Sanpaolo SpA, Strike Price EUR1.40 ±	181.664	0,01
162	19.01.2024	ITT Inc, Strike Price $45.00 ±	0	0,00
111	19.01.2024	ITT Inc, Strike Price $55.00 ±	0	0,00
216	19.01.2024	ITT Inc, Strike Price $65.00 ±	0	0,00
68	19.01.2024	ITT Inc, Strike Price $70.00 ±	0	0,00
169	11.01.2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW320.00 ±	2.624	0,00
101	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $30.00 ±	0	0,00
607	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $33.00 ±	0	0,00
125	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $35.00 ±	125	0,00
80	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $38.00 ±	160	0,00
166	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $41.00 ±	498	0,00
104	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $42.00 ±	572	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
68	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $45.00 ±	2.754	0,00
143	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $48.00 ±	33.033	0,00
87	19.01.2024	Kroger Co, Strike Price $50.00 ±	36.757	0,00
52.655	13.06.2024	L&F Co Ltd, Strike Price KRW143,850.00 ∞	727.616	0,05
27	19.01.2024	Lam Research Corp, Strike Price $350.00 ±	0	0,00
9	19.01.2024	Lam Research Corp, Strike Price $420.00 ±	0	0,00
13	19.01.2024	Lam Research Corp, Strike Price $430.00 ±	0	0,00
8	19.01.2024	Lam Research Corp, Strike Price $500.00 ±	72	0,00
11	19.01.2024	Lam Research Corp, Strike Price $510.00 ±	313	0,00
175	19.01.2024	Las Vegas Sands Corp, Strike Price $42.00 ±	1.225	0,00
123	19.01.2024	Las Vegas Sands Corp, Strike Price $50.00 ±	21.217	0,00
228	15.03.2024	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price $55.00 ±	9.120	0,00
3.581	15.03.2024	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price $65.00 ±	170.097	0,01
199	19.01.2024	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price $75.00 ±	1.990	0,00
6.912	21.06.2024	Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP20.00 ±	0	0,00
11.810	21.06.2024	Lloyds Banking Group Plc, Strike Price GBP24.00 ±	0	0,00
201	19.01.2024	Louisiana-Pacific Corp, Strike Price $32.50 ±	0	0,00
118	19.01.2024	Louisiana-Pacific Corp, Strike Price $42.50 ±	0	0,00
84	19.01.2024	Louisiana-Pacific Corp, Strike Price $50.00 ±	630	0,00
60	19.01.2024	Louisiana-Pacific Corp, Strike Price $60.00 ±	540	0,00
57	21.06.2024	Lowe's Companies Inc, Strike Price $140.00 ±	2.793	0,00
39	21.06.2024	Lowe's Companies Inc, Strike Price $170.00 ±	6.045	0,00
28	21.06.2024	Lowe's Companies Inc, Strike Price $200.00 ±	14.840	0,00
32	19.01.2024	Lululemon Athletica Inc, Strike Price $260.00 ±	0	0,00
22	19.01.2024	Lululemon Athletica Inc, Strike Price $320.00 ±	77	0,00
15	19.01.2024	Lululemon Athletica Inc, Strike Price $380.00 ±	202	0,00
82	19.01.2024	LyondellBasell Industries NV, Strike Price $64.80 ±	0	0,00
113	21.06.2024	LyondellBasell Industries NV, Strike Price $65.00 ±	2.825	0,00
67	19.01.2024	LyondellBasell Industries NV, Strike Price $79.80 ±	0	0,00
75	21.06.2024	LyondellBasell Industries NV, Strike Price $80.00 ±	11.625	0,00
60	19.01.2024	LyondellBasell Industries NV, Strike Price $89.80 ±	2.400	0,00
54	21.06.2024	LyondellBasell Industries NV, Strike Price $95.00 ±	31.320	0,00
429	19.01.2024	Marathon Oil Corp, Strike Price $16.00 ±	0	0,00
658	19.01.2024	Marathon Oil Corp, Strike Price $17.00 ±	1.974	0,00
438	21.06.2024	Marathon Oil Corp, Strike Price $18.00 ±	17.082	0,00
294	21.06.2024	Marathon Oil Corp, Strike Price $22.00 ±	36.750	0,00
228	21.06.2024	Marathon Oil Corp, Strike Price $25.00 ±	58.482	0,01
696	19.04.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price $80.00 ±	431.520	0,03

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
2.493.838	27.06.2024	Meituan, Strike Price HKD74.20 ∞	1.865.008	0,12
27	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $200.00 ±	3.564	0,00
32	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $225.00 ±	7.440	0,00
36	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $235.00 ±	10.512	0,00
20	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $240.00 ±	6.500	0,00
24	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $270.00 ±	15.060	0,00
25	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $280.00 ±	19.438	0,00
13	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $285.00 ±	11.213	0,00
18	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $320.00 ±	30.465	0,00
19	21.06.2024	Meta Platforms Inc, Strike Price $330.00 ±	38.428	0,00
71	16.10.2024	Metlife Inc, Strike Price $71.00 ±	52.402	0,00
71	17.10.2024	Metlife Inc, Strike Price $71.00 ±	52.432	0,00
71	18.10.2024	Metlife Inc, Strike Price $71.00 ±	52.473	0,00
130	21.06.2024	Microchip Technology Inc, Strike Price $55.00 ±	5.850	0,00
88	21.06.2024	Microchip Technology Inc, Strike Price $67.50 ±	9.900	0,00
63	21.06.2024	Microchip Technology Inc, Strike Price $80.00 ±	21.735	0,00
89	19.01.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $45.00 ±	178	0,00
153	21.06.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $47.50 ±	3.366	0,00
76	19.01.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $52.50 ±	988	0,00
163	21.06.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $52.50 ±	5.868	0,00
151	21.06.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $55.00 ±	6.946	0,00
97	21.06.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $60.00 ±	7.469	0,00
63	19.01.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $62.50 ±	126	0,00
108	21.06.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $65.00 ±	13.608	0,00
100	21.06.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $67.50 ±	15.950	0,00
72	21.06.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $70.00 ±	14.508	0,00
153	21.06.2024	Micron Technology Inc, Strike Price $77.50 ±	58.905	0,01
600	15.03.2024	Middleby Corp, Strike Price $95.00 ±	13.500	0,00
70	15.03.2024	Nasdaq 100 E-mini Put Option on Future, Strike Price $16,000.00 ±	276.850	0,02
128	15.03.2024	Nasdaq 100 E-mini Put Option on Future, Strike Price $16,500.00 ±	794.240	0,05
11.505	21.06.2024	Natwest Group Plc, Strike Price GBP120.00 ±	36.666	0,00
234	19.01.2024	NetApp Inc, Strike Price $55.00 ±	0	0,00
19	21.06.2024	Netflix Inc, Strike Price $280.00 ±	3.410	0,00
20	17.01.2025	Netflix Inc, Strike Price $310.00 ±	23.000	0,00
26	21.06.2024	Netflix Inc, Strike Price $330.00 ±	11.375	0,00
13	21.06.2024	Netflix Inc, Strike Price $340.00 ±	6.760	0,00
14	17.01.2025	Netflix Inc, Strike Price $380.00 ±	33.880	0,00
10	21.06.2024	Netflix Inc, Strike Price $400.00 ±	13.500	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
19	21.06.2024	Netflix Inc, Strike Price $405.00 ±	27.503	0,00
11	17.01.2025	Netflix Inc, Strike Price $440.00 ±	44.385	0,00
13	21.06.2024	Netflix Inc, Strike Price $475.00 ±	47.223	0,00
55	21.06.2024	Neurocrine Biosciences Inc, Strike Price $110.00 ±	12.650	0,00
117	21.06.2024	Neurocrine Biosciences Inc, Strike Price $75.00 ±	4.973	0,00
73	21.06.2024	Neurocrine Biosciences Inc, Strike Price $95.00 ±	6.753	0,00
4.995	15.03.2024	Nexi SpA, Strike Price EUR4.40 ±	30.072	0,00
259	12.01.2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY32,250.00 ±	112.066	0,01
135	12.01.2024	Nikkei 225 Index, Strike Price JPY32,750.00 ±	119.698	0,01
3.781	16.02.2024	NIO Inc, Strike Price $6.00 ±	30.248	0,00
12.802	17.05.2024	NIO Inc, Strike Price $6.00 ±	441.669	0,03
909	21.06.2024	NIO Inc, Strike Price $7.50 ±	80.447	0,01
6.081	15.03.2024	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd, Strike Price $11.00 ±	112.499	0,01
3.466	15.03.2024	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd, Strike Price $12.00 ±	71.053	0,01
266	17.05.2024	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd, Strike Price $12.50 ±	5.586	0,00
81	21.06.2024	Nucor Corp, Strike Price $110.00 ±	4.982	0,00
55	21.06.2024	Nucor Corp, Strike Price $135.00 ±	11.110	0,00
42	21.06.2024	Nucor Corp, Strike Price $155.00 ±	22.890	0,00
37	19.01.2024	NVIDIA Corp, Strike Price $170.00 ±	74	0,00
24	19.01.2024	NVIDIA Corp, Strike Price $215.00 ±	24	0,00
16	19.01.2024	NVIDIA Corp, Strike Price $260.00 ±	16	0,00
147	15.03.2024	Ocado Group Plc, Strike Price GBP460.00 ±	29.515	0,00
109	15.03.2024	Ocado Group Plc, Strike Price GBP520.00 ±	30.917	0,00
440	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price $80.00 ±	17.600	0,00
870	21.06.2024	ON Semiconductor Corp, Strike Price $45.00 ±	73.080	0,01
40	19.01.2024	ON Semiconductor Corp, Strike Price $85.00 ±	13.700	0,00
196	19.01.2024	ONEOK Inc, Strike Price $42.50 ±	0	0,00
201	21.06.2024	ONEOK Inc, Strike Price $47.50 ±	0	0,00
128	19.01.2024	ONEOK Inc, Strike Price $52.50 ±	640	0,00
138	21.06.2024	ONEOK Inc, Strike Price $57.50 ±	11.040	0,00
99	19.01.2024	ONEOK Inc, Strike Price $60.00 ±	99	0,00
101	21.06.2024	ONEOK Inc, Strike Price $67.50 ±	32.320	0,00
314	15.03.2024	Ormat Technologies Inc, Strike Price $45.00 ±	75.360	0,01
290	15.03.2024	Ormat Technologies Inc, Strike Price $60.00 ±	26.100	0,00
750.000	21.11.2025	Palo Alto Networks Inc, Strike Price $136.16 ∞	3.677.696	0,23
3.062	19.01.2024	Peabody Energy Corp, Strike Price $14.00 ±	0	0,00
4.363	19.01.2024	Peabody Energy Corp, Strike Price $16.00 ±	0	0,00
2.185	19.04.2024	Peabody Energy Corp, Strike Price $16.00 ±	37.145	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
550	19.01.2024	PG&E Corp, Strike Price $11.00 ±	0	0,00
1.695	19.01.2024	PG&E Corp, Strike Price $12.00 ±	0	0,00
604	17.01.2025	PG&E Corp, Strike Price $12.00 ±	22.650	0,00
838	19.01.2024	PG&E Corp, Strike Price $15.00 ±	2.514	0,00
388	17.01.2025	PG&E Corp, Strike Price $15.00 ±	28.906	0,00
740	19.01.2024	PG&E Corp, Strike Price $17.00 ±	5.920	0,00
302	17.01.2025	PG&E Corp, Strike Price $17.00 ±	38.354	0,00
820	19.01.2024	PG&E Corp, Strike Price $9.00 ±	0	0,00
40	19.01.2024	Pioneer Natural Resources Co, Strike Price $155.00 ±	0	0,00
33	19.01.2024	Pioneer Natural Resources Co, Strike Price $190.00 ±	660	0,00
28	19.01.2024	Pioneer Natural Resources Co, Strike Price $220.00 ±	5.950	0,00
739	17.07.2024	POSCO Holdings Inc, Strike Price KRW341,600.00 ∞	2.823	0,00
16.000.000	27.03.2024	Postal Savings Bank of China Co Ltd, Strike Price HKD2.80 ∞	20.613	0,00
1.416	19.01.2024	PPL Corporation, Strike Price $19.00 ±	0	0,00
140	19.01.2024	PPL Corporation, Strike Price $20.00 ±	0	0,00
124	21.06.2024	Prudential Financial Inc, Strike Price $70.00 ±	3.720	0,00
90	21.06.2024	Prudential Financial Inc, Strike Price $82.50 ±	9.450	0,00
64	21.06.2024	Prudential Financial Inc, Strike Price $97.50 ±	24.320	0,00
109	19.01.2024	Qorvo Inc, Strike Price $70.00 ±	0	0,00
74	19.01.2024	Qorvo Inc, Strike Price $85.00 ±	1.036	0,00
45	21.06.2024	Ralph Lauren Corp, Strike Price $115.00 ±	9.563	0,00
68	19.01.2024	Ralph Lauren Corp, Strike Price $130.00 ±	1.700	0,00
92	21.06.2024	Ralph Lauren Corp, Strike Price $80.00 ±	4.370	0,00
64	21.06.2024	Ralph Lauren Corp, Strike Price $95.00 ±	4.000	0,00
389	19.01.2024	Range Resources Corp, Strike Price $18.00 ±	0	0,00
261	19.01.2024	Range Resources Corp, Strike Price $22.00 ±	0	0,00
680	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $23.00 ±	47.600	0,00
188	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $25.00 ±	20.680	0,00
187	19.01.2024	Range Resources Corp, Strike Price $26.00 ±	1.870	0,00
238	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $27.00 ±	38.080	0,00
236	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $28.00 ±	45.430	0,00
130	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $30.00 ±	35.750	0,00
170	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $32.00 ±	64.600	0,01
172	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $33.00 ±	75.680	0,01
96	21.06.2024	Range Resources Corp, Strike Price $35.00 ±	54.720	0,00
34	19.01.2024	RH, Strike Price $175.00 ±	0	0,00
38	19.01.2024	RH, Strike Price $195.00 ±	380	0,00
29	19.01.2024	RH, Strike Price $210.00 ±	507	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
27	19.01.2024	RH, Strike Price $230.00 ±	1.147	0,00
25	19.01.2024	RH, Strike Price $250.00 ±	2.937	0,00
20	21.06.2024	RH, Strike Price $250.00 ±	35.800	0,00
18	19.01.2024	RH, Strike Price $280.00 ±	11.700	0,00
14	21.06.2024	RH, Strike Price $300.00 ±	55.440	0,00
12	21.06.2024	RH, Strike Price $350.00 ±	85.680	0,01
280	15.03.2024	Rheinmetall AG, Strike Price EUR170.00 ±	18.713	0,00
555	21.06.2024	Rheinmetall AG, Strike Price EUR200.00 ±	167.065	0,01
4.170	15.03.2024	Rivian Automotive Inc, Strike Price $12.50 ±	64.635	0,01
701	15.03.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,350.00 ±	665.950	0,04
140	15.03.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,400.00 ±	154.000	0,01
196	16.02.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,500.00 ±	151.900	0,01
131	15.03.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,500.00 ±	199.775	0,01
230	15.03.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,550.00 ±	419.750	0,03
151	15.03.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,600.00 ±	332.200	0,02
2	19.01.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,620.00 ±	635	0,00
173	15.03.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,650.00 ±	456.288	0,03
4	15.03.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,800.00 ±	18.850	0,00
1	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,740.00 ±	2.760	0,00
1	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,770.00 ±	3.790	0,00
502	21.06.2024	Saipem SpA, Strike Price EUR1.00 ±	18.743	0,00
190	20.09.2024	Saipem SpA, Strike Price EUR1.00 ±	8.878	0,00
4.653	15.03.2024	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price $42.50 ±	137.264	0,01
750	15.03.2024	Semtech Corp, Strike Price $15.00 ±	22.500	0,00
17	19.01.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $310.00 ±	0	0,00
14	19.01.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $370.00 ±	0	0,00
19	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $400.00 ±	5.035	0,00
12	19.01.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $440.00 ±	0	0,00
19	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $470.00 ±	9.405	0,00
33	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $480.00 ±	13.943	0,00
11	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $560.00 ±	12.870	0,00
14	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $570.00 ±	17.430	0,00
13	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $580.00 ±	19.630	0,00
10	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $670.00 ±	38.650	0,00
11	21.06.2024	ServiceNow Inc, Strike Price $680.00 ±	47.685	0,00
37	19.01.2024	Sherwin-Williams Co, Strike Price $165.00 ±	0	0,00
31	19.01.2024	Sherwin-Williams Co, Strike Price $200.00 ±	310	0,00
26	19.01.2024	Sherwin-Williams Co, Strike Price $240.00 ±	130	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
130	19.04.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $30.00 ±	5.200	0,00
34	19.04.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $35.00 ±	0	0,00
391	19.01.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $40.00 ±	1.564	0,00
86	19.04.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $45.00 ±	19.780	0,00
54	19.01.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $50.00 ±	324	0,00
625	19.04.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $50.00 ±	68.750	0,01
912	19.01.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $65.00 ±	38.760	0,00
2.090	19.07.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $67.88 ∞	1.236.314	0,08
7.007	19.07.2024	Sibanye Stillwater Ltd, Strike Price $2.50 ±	0	0,00
5.332	21.06.2024	Siemens Energy AG, Strike Price EUR10.00 ±	412.300	0,03
14.040	20.12.2024	Siemens Energy AG, Strike Price EUR10.00 ±	1.822.341	0,11
398	21.06.2024	Siemens Energy AG, Strike Price EUR5.20 ±	3.957	0,00
930	20.09.2024	Siemens Energy AG, Strike Price EUR5.20 ±	15.924	0,00
1.833	21.06.2024	Siemens Energy AG, Strike Price EUR6.00 ±	33.410	0,00
86	21.06.2024	Signet Jewelers Ltd, Strike Price $55.00 ±	7.310	0,00
62	21.06.2024	Signet Jewelers Ltd, Strike Price $65.00 ±	9.145	0,00
47	21.06.2024	Signet Jewelers Ltd, Strike Price $75.00 ±	11.045	0,00
78	21.06.2024	Simon Property Group Inc, Strike Price $105.00 ±	8.385	0,00
54	21.06.2024	Simon Property Group Inc, Strike Price $125.00 ±	18.900	0,00
116	21.06.2024	Simon Property Group Inc, Strike Price $85.00 ±	4.350	0,00
258.916	11.01.2024	SK Hynix Inc, Strike Price KRW70,560.00 ∞	0	0,00
541	19.01.2024	Skechers USA Inc, Strike Price $35.00 ±	0	0,00
52	19.01.2024	Skyworks Solutions Inc, Strike Price $100.00 ±	910	0,00
77	19.01.2024	Skyworks Solutions Inc, Strike Price $110.00 ±	10.780	0,00
45	19.01.2024	Skyworks Solutions Inc, Strike Price $115.00 ±	17.100	0,00
63	19.01.2024	Skyworks Solutions Inc, Strike Price $82.50 ±	189	0,00
107	19.01.2024	Skyworks Solutions Inc, Strike Price $92.50 ±	2.407	0,00
2.520	19.01.2024	Southern Co, Strike Price $47.50 ±	0	0,00
840	16.02.2024	Southern Co, Strike Price $47.50 ±	0	0,00
736	19.01.2024	Southern Co, Strike Price $50.00 ±	0	0,00
50	19.01.2024	Southern Co, Strike Price $52.50 ±	0	0,00
10	21.06.2024	Standard Chartered Plc, Strike Price GBP480.00 ±	606	0,00
939	20.09.2024	Standard Chartered Plc, Strike Price GBP480.00 ±	101.748	0,01
153	15.03.2024	Swiss Prime Site AG, Strike Price CHF56.00 ±	182	0,00
267	20.09.2024	Swiss Prime Site AG, Strike Price CHF64.00 ±	13.958	0,00
54	19.01.2024	T Rowe Price Group Inc, Strike Price $110.00 ±	18.360	0,00
40	17.01.2025	T Rowe Price Group Inc, Strike Price $110.00 ±	49.200	0,00
83	17.01.2025	T Rowe Price Group Inc, Strike Price $75.00 ±	18.468	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
74	19.01.2024	T Rowe Price Group Inc, Strike Price $80.00 ±	0	0,00
63	19.01.2024	T Rowe Price Group Inc, Strike Price $95.00 ±	472	0,00
52	17.01.2025	T Rowe Price Group Inc, Strike Price $95.00 ±	33.020	0,00
13	17.01.2024	Taiwan Stock Exchange Index, Strike Price TWD17,800.00 ±	3.749	0,00
79	19.01.2024	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price $100.00 ±	0	0,00
73	21.06.2024	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price $100.00 ±	10.476	0,00
55	19.01.2024	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price $120.00 ±	0	0,00
52	21.06.2024	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price $120.00 ±	7.722	0,00
36	21.06.2024	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price $145.00 ±	19.620	0,00
92	19.01.2024	Take-Two Interactive Software Inc, Strike Price $75.00 ±	0	0,00
385	19.01.2024	Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price $18.00 ±	0	0,00
258	19.01.2024	Tanger Factory Outlet Centers Inc, Strike Price $22.00 ±	258	0,00
163	19.01.2024	Targa Resources Corp, Strike Price $40.00 ±	0	0,00
224	19.01.2024	Targa Resources Corp, Strike Price $50.00 ±	0	0,00
237	19.01.2024	Targa Resources Corp, Strike Price $55.00 ±	0	0,00
175	19.01.2024	Targa Resources Corp, Strike Price $60.00 ±	0	0,00
158	19.01.2024	Targa Resources Corp, Strike Price $67.50 ±	0	0,00
87	19.01.2024	Targa Resources Corp, Strike Price $70.00 ±	0	0,00
67	21.06.2024	TD SYNNEX Corp, Strike Price $100.00 ±	26.800	0,00
133	21.06.2024	TD SYNNEX Corp, Strike Price $70.00 ±	4.988	0,00
91	21.06.2024	TD SYNNEX Corp, Strike Price $85.00 ±	11.148	0,00
116	19.01.2024	Tenet Healthcare Corp, Strike Price $50.00 ±	348	0,00
98	19.01.2024	Tenet Healthcare Corp, Strike Price $60.00 ±	4.900	0,00
84	19.01.2024	Tenet Healthcare Corp, Strike Price $70.00 ±	4.830	0,00
35	21.06.2024	Tesla Motors Inc, Strike Price $150.00 ±	10.850	0,00
24	21.06.2024	Tesla Motors Inc, Strike Price $183.33 ±	18.300	0,00
17	21.06.2024	Tesla Motors Inc, Strike Price $216.67 ±	27.625	0,00
375	15.03.2024	Tetra Tech Inc, Strike Price $120.00 ±	0	0,00
46	19.01.2024	Texas Instruments Inc, Strike Price $125.00 ±	230	0,00
37	19.01.2024	Texas Instruments Inc, Strike Price $155.00 ±	851	0,00
57	21.06.2024	Thor Industries Inc, Strike Price $105.00 ±	28.785	0,00
126	21.06.2024	Thor Industries Inc, Strike Price $70.00 ±	8.820	0,00
88	21.06.2024	Thor Industries Inc, Strike Price $85.00 ±	12.760	0,00
312.085	21.06.2024	T-Mobile US Inc, Strike Price $121.54 ∞	228.663	0,02
36	19.01.2024	Tractor Supply Co, Strike Price $160.00 ±	0	0,00
29	19.01.2024	Tractor Supply Co, Strike Price $195.00 ±	1.087	0,00
25	19.01.2024	Tractor Supply Co, Strike Price $230.00 ±	37.000	0,00
5.027	15.03.2024	Ubisoft Entertainment SA, Strike Price EUR18.00 ±	372.056	0,02

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
10.370	15.03.2024	UBS Group AG, Strike Price CHF12.00 ±	36.963	0,00
12	19.01.2024	Ulta Beauty Inc, Strike Price $360.00 ±	96	0,00
16	19.01.2024	Ulta Beauty Inc, Strike Price $380.00 ±	480	0,00
9	19.01.2024	Ulta Beauty Inc, Strike Price $440.00 ±	495	0,00
13	19.01.2024	Ulta Beauty Inc, Strike Price $460.00 ±	1.885	0,00
713	21.06.2024	UniCredit SpA, Strike Price EUR10.00 ±	40.208	0,00
2.405	21.06.2024	UniCredit SpA, Strike Price EUR11.00 ±	144.789	0,01
666.400 USD	07.03.2024	United States Dollar/Chinese Yuan Renminbi Currency Digital Down & In Option, Strike Price 6.00 ∞	167	0,00
439	19.01.2024	United States Steel Corp, Strike Price $13.00 ±	439	0,00
306	19.01.2024	United States Steel Corp, Strike Price $15.00 ±	306	0,00
213	19.01.2024	United States Steel Corp, Strike Price $18.00 ±	213	0,00
143	19.01.2024	United States Steel Corp, Strike Price $22.00 ±	143	0,00
68	21.06.2024	Universal Display Corp, Strike Price $120.00 ±	11.390	0,00
47	21.06.2024	Universal Display Corp, Strike Price $145.00 ±	16.685	0,00
35	21.06.2024	Universal Display Corp, Strike Price $170.00 ±	29.750	0,00
92	19.01.2024	Valero Energy Corp, Strike Price $80.00 ±	0	0,00
7.369	15.03.2024	Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price $1.00 ±	29.476	0,00
10.827	19.01.2024	Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price $1.50 ±	27.068	0,00
9.570	15.03.2024	Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price $1.50 ±	110.055	0,01
2.667	19.01.2024	Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price $2.00 ±	18.669	0,00
1.910	15.03.2024	Virgin Galactic Holdings Inc, Strike Price $2.00 ±	47.750	0,00
3.371	16.02.2024	Vishay Intertechnology Inc, Strike Price $17.50 ±	42.138	0,00
184	21.06.2024	Voya Financial Inc, Strike Price $50.00 ±	5.060	0,00
129	21.06.2024	Voya Financial Inc, Strike Price $60.00 ±	11.610	0,00
93	21.06.2024	Voya Financial Inc, Strike Price $70.00 ±	27.203	0,00
47	19.01.2024	Walmart Inc, Strike Price $100.00 ±	47	0,00
38	19.01.2024	Walmart Inc, Strike Price $125.00 ±	76	0,00
32	19.01.2024	Walmart Inc, Strike Price $145.00 ±	448	0,00
22	21.06.2024	West Pharmaceutical Services Inc, Strike Price $270.00 ±	11.000	0,00
16	21.06.2024	West Pharmaceutical Services Inc, Strike Price $330.00 ±	24.160	0,00
12	21.06.2024	West Pharmaceutical Services Inc, Strike Price $390.00 ±	54.840	0,00
338	21.06.2024	Western Digital Corp, Strike Price $30.00 ±	18.083	0,00
258	21.06.2024	Western Digital Corp, Strike Price $32.50 ±	15.609	0,00
170	21.06.2024	Western Digital Corp, Strike Price $40.00 ±	17.340	0,00
121	21.06.2024	Western Digital Corp, Strike Price $47.50 ±	35.877	0,00
52	21.06.2024	Wingstop Inc, Strike Price $160.00 ±	10.010	0,00
37	21.06.2024	Wingstop Inc, Strike Price $195.00 ±	20.165	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte 17,42 % (31. Dezember 2022: 6,48 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
28	21.06.2024	Wingstop Inc, Strike Price $230.00 ±	35.840	0,00
141	19.01.2024	Winnebago Industries Inc, Strike Price $40.00 ±	0	0,00
124	21.06.2024	Winnebago Industries Inc, Strike Price $40.00 ±	14.880	0,00
113	19.01.2024	Winnebago Industries Inc, Strike Price $50.00 ±	339	0,00
81	21.06.2024	Winnebago Industries Inc, Strike Price $50.00 ±	5.468	0,00
94	19.01.2024	Winnebago Industries Inc, Strike Price $60.00 ±	470	0,00
58	21.06.2024	Winnebago Industries Inc, Strike Price $60.00 ±	11.600	0,00
310	15.03.2024	Wolfspeed Inc, Strike Price $30.00 ±	34.100	0,00
50	19.01.2024	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price $105.00 ±	69.625	0,01
65	19.01.2024	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price $77.50 ±	1.235	0,00
55	19.01.2024	Wyndham Worldwide Corp, Strike Price $92.50 ±	17.875	0,00
8.000	21.06.2024	ZTO Express Cayman Inc, Strike Price $13.00 ±	120.000	0,01
Beizulegender Zeitwert aus gekauften Optionskontrakten insgesamt ± (Prämie: (423.257.135) US$)			**283.236.382**	**17,42**

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind Bank of America Merrill Lynch, BNP Paribas, Daiwa, Goldman Sachs International, JPMorgan Chase Bank, Morgan Stanley, Nomura International, SMBC Nikko Capital Markets Ltd und UBS AG.

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettovermögens
100	3D Systems Corp	Morgan Stanley	19	0,00
(170.361)	3M Co	Goldman Sachs International	3.818	0,00
(730.949)	3M Co	Morgan Stanley	49.303	0,00
(49.182)	89bio Inc	JPMorgan Chase Bank	26.482	0,00
9.024	8x8 Inc	Morgan Stanley	2.140	0,00
100	AAON Inc	Morgan Stanley	155	0,00
(45.116)	AbbVie Inc	Morgan Stanley	2.461	0,00
(642.442)	AbbVie Inc	Goldman Sachs International	16.703	0,00
(1.229.145)	AbbVie Inc	JPMorgan Chase Bank	58.198	0,01
(1.176)	ABM Industries Inc	Morgan Stanley	1.493	0,00
(2.591.887)	Academy Sports & Outdoors Inc	Morgan Stanley	712.778	0,05
542	Acadia Healthcare Co Inc	Morgan Stanley	748	0,00
(594.432)	Acadia Healthcare Co Inc	Goldman Sachs International	27.401	0,00
12.208	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	22.741	0,00
4.126	Acadia Realty Trust	Morgan Stanley	84	0,00
(75.779)	Acuity Brands Inc	Morgan Stanley	21.786	0,00
(107.810)	Adidas AG	JPMorgan Chase Bank	1.697	0,00
(476)	Adient Plc	Morgan Stanley	87	0,00
101	ADMA Biologics Inc	Morgan Stanley	37	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(99.839)	Adobe Inc	JPMorgan Chase Bank	2.009	0,00
1.125.088	Adobe Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
37	Advance Auto Parts Inc	Morgan Stanley	23	0,00
298.938	Advanced Energy Industries	Nomura	0	0,00
1.806.846	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(93.615)	Advanced Micro Devices Inc	Morgan Stanley	9.457	0,00
(5.117)	Advantage Solutions Inc	Morgan Stanley	1.688	0,00
(72.271)	Adyen NV	Goldman Sachs International	19.310	0,00
(27.161)	Adyen NV	JPMorgan Chase Bank	7.337	0,00
(130.693)	AECOM	Morgan Stanley	7.000	0,00
(962)	Aehr Test Systems	Morgan Stanley	1.648	0,00
1.036.081	AeroVironment Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.205)	AerSale Corp	Morgan Stanley	129	0,00
(85.303)	AES Corp	Morgan Stanley	46.063	0,00
(82.921)	Affiliated Managers Group Inc	Morgan Stanley	13.347	0,00
3.729	Affirm Holdings Inc	Morgan Stanley	4.793	0,00
(86.878)	AGCO Corp	Morgan Stanley	3.309	0,00
(1.014)	Agilent Technologies Inc	Morgan Stanley	574	0,00
1.942	Agiliti Inc	Morgan Stanley	444	0,00
55.103	agilon health Inc	Morgan Stanley	9.769	0,00
35.806	Agios Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	5.347	0,00
(39.633)	AGNC Investment Corp	Morgan Stanley	612	0,00
150.217	AIB Group Plc	Goldman Sachs International	13.647	0,00
309.036.600	Aica Kogyo Co Ltd	Société Générale	0	0,00
(81.395)	Air Lease Corp	Morgan Stanley	9.983	0,00
9	Air Products & Chemicals Inc	Morgan Stanley	0	0,00
427	Air Transport Services Group Inc	Morgan Stanley	135	0,00
(86.030)	Airbnb Inc Class A	Morgan Stanley	9.455	0,00
3.230	Airbnb Inc Class A	Goldman Sachs International	257	0,00
(410.960)	Akamai Technologies Inc	Nomura	0	0,00
(179.545)	Akero Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	93.706	0,01
(32.443)	Alarm.com Holdings Inc	Goldman Sachs International	4.265	0,00
(73.748)	Alarm.com Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	9.021	0,00
(5.404)	Alarm.com Holdings Inc	Morgan Stanley	322	0,00
580	Albany International Corp Class A	Morgan Stanley	1.074	0,00
(5.222)	Albemarle Corp	Morgan Stanley	3.124	0,00
(1.219.407)	Albertsons Cos Inc Class A	Morgan Stanley	44.471	0,00
(74.973)	Alector Inc	Goldman Sachs International	26.613	0,00
(117.512)	Alector Inc	JPMorgan Chase Bank	43.650	0,00
(50.372)	Alector Inc	Morgan Stanley	477	0,00
6.451	Alexander & Baldwin Inc	Morgan Stanley	229	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(2.005)	Alexandria Real Estate Equities Inc	Morgan Stanley	3.085	0,00
(379)	Algonquin Power & Utilities Corp	Morgan Stanley	73	0,00
276.003	Align Technology Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
204	Alkami Technology Inc	Morgan Stanley	76	0,00
8.645	Alkermes Plc	Morgan Stanley	3.107	0,00
111.511	Allegion Plc	Goldman Sachs International	903	0,00
(18)	Allego NV	Goldman Sachs International	0	0,00
251	ALLETE Inc	Morgan Stanley	55	0,00
516	Alliant Energy Corp	Morgan Stanley	6	0,00
(374.355)	Allianz SE	Goldman Sachs International	8.607	0,00
(89.761)	Allison Transmission Holdings Inc	Morgan Stanley	1.606	0,00
4.436	Allstate Corp	Morgan Stanley	13.957	0,00
8.422	Allurion Techno	Goldman Sachs International	0	0,00
(110.198)	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	42.544	0,00
(326.818)	Alphabet Inc Class C	Morgan Stanley	48.474	0,01
1.994	Alphatec Holdings Inc	Morgan Stanley	426	0,00
(847)	Alpine Immune Sciences Inc	Morgan Stanley	268	0,00
(2.266.155)	Amazon.com Inc	Morgan Stanley	256.355	0,02
(370.926)	Amazon.com Inc	JPMorgan Chase Bank	33.593	0,00
(398.050)	Amazon.com Inc	Goldman Sachs International	40.732	0,00
(23.631)	Ambrx Biopharma Inc	Goldman Sachs International	9.654	0,00
(13.925)	Ambrx Biopharma Inc	JPMorgan Chase Bank	8.583	0,00
(11.694)	Ambrx Biopharma Inc	Morgan Stanley	2.804	0,00
(9.047)	AMC Entertainment Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	2.280	0,00
(80.823)	Amdocs Ltd	Morgan Stanley	9.022	0,00
8.042.571	American Airlines Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
29.460.000	American Airlines Group Inc	Nomura	1.346.434	0,09
(2.563)	American Airlines Group Inc	Morgan Stanley	1.340	0,00
(3.001)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Morgan Stanley	270	0,00
(301)	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	30	0,00
1.219	American Express Co	Morgan Stanley	3.923	0,00
(106.049)	American International Group Inc	Morgan Stanley	24.187	0,00
404	American Software Inc Class A	Morgan Stanley	167	0,00
(8.642)	American Tower Corp	JPMorgan Chase Bank	168	0,00
(20.988)	American Tower Corp	Morgan Stanley	715	0,00
(64.949)	American Tower Corp	Goldman Sachs International	9.614	0,00
(141)	American Water Works Co Inc	Morgan Stanley	101	0,00
(118.527)	Ameriprise Financial Inc	Morgan Stanley	20.504	0,00
1.139.142	Ameriprise Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
184.566	AmerisourceBergen Corp	Goldman Sachs International	90.347	0,01
(159.380)	Amgen Inc	JPMorgan Chase Bank	13.693	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(40.171)	Amgen Inc	Morgan Stanley	29.574	0,00
(344.795)	Amgen Inc	Goldman Sachs International	27.183	0,00
4.622	Amicus Therapeutics Inc	Morgan Stanley	5.482	0,00
(49)	Amkor Technology Inc	Morgan Stanley	6	0,00
231	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	531	0,00
(1.483.329)	ams AG	Goldman Sachs International	0	0,00
13.500.000	ams-OSRAM AG	Société Générale	1.124.303	0,07
2.718	Amylyx Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	2.150	0,00
7.003.784.700	ANA Holdings Inc	Société Générale	1.388.232	0,09
(116.844)	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	10.188	0,00
(34.573)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.996)	Anavex Life Sciences Corp	Morgan Stanley	475	0,00
658	AngioDynamics Inc	Morgan Stanley	165	0,00
(1.136.272)	Anheuser-Busch Inbev SA	Goldman Sachs International	90.210	0,01
(657.746)	Anheuser-Busch Inbev SA	JPMorgan Chase Bank	27.592	0,00
253	ANI Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	674	0,00
(11.983)	Annaly Capital Management Inc	Morgan Stanley	9.491	0,00
(100)	Anterix Inc	Morgan Stanley	109	0,00
(9.103)	Antero Resources Corp	Morgan Stanley	2.787	0,00
5.808	Anywhere Real Estate Inc	Morgan Stanley	2.562	0,00
(110.912)	AO Smith Corp	Morgan Stanley	27.999	0,00
214	Aon Plc Class A	Morgan Stanley	371	0,00
467.037	APA Corp	JPMorgan Chase Bank	10.005	0,00
(3.368)	APA Corp	Morgan Stanley	979	0,00
(76.796)	Apartment Income REIT Corp	Morgan Stanley	14.580	0,00
4.964	Apartment Investment & Management Co Class A	Morgan Stanley	198	0,00
17.194.831	Apellis Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(17.822)	Apple Hospitality REIT Inc	Morgan Stanley	6.001	0,00
2.504.446	Apple Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(448.496)	Apple Inc	Morgan Stanley	30.712	0,00
(5.511)	Applied Digital Corp	Morgan Stanley	546	0,00
(161.024)	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	20.502	0,00
1.550.460	Applied Materials Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(78.526)	AppLovin Corp Class A	Goldman Sachs International	5.739	0,00
(83.583)	AppLovin Corp Class A	Morgan Stanley	1.771	0,00
(3)	Arbor Realty Trust Inc	Morgan Stanley	2	0,00
915	Arcellx Inc	Morgan Stanley	3.589	0,00
70.778	Arch Capital Group Ltd	Morgan Stanley	4.542	0,00
3.607	Archer-Daniels-Midland Co	Morgan Stanley	2.606	0,00
8.922	Archrock Inc	Morgan Stanley	411	0,00
(348)	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	Morgan Stanley	15	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
7.238	Ares Capital Corp	Morgan Stanley	2.017	0,00
(293.332)	Argenx SE	Morgan Stanley	9.833	0,00
213	Arhaus Inc	Morgan Stanley	148	0,00
(71.566)	Armstrong World Industries Inc	Morgan Stanley	27.598	0,00
22.867	Arqit Quantum Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(145)	Array Technologies Inc	Morgan Stanley	14	0,00
(1.178)	Arrow Electronics Inc	Morgan Stanley	1.877	0,00
52.104	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	215	0,00
(121)	Artivion Inc	Morgan Stanley	23	0,00
562	ASGN Inc	Morgan Stanley	782	0,00
(135)	Ashland Inc	Morgan Stanley	151	0,00
(145.180)	ASR Nederland NV	Goldman Sachs International	33.279	0,00
(7.306)	Associated Banc-Corp	Morgan Stanley	925	0,00
5.214.873	Astellas Pharma Inc	Goldman Sachs International	5.915	0,00
(208.757)	AstraZeneca Plc	Morgan Stanley	1.450	0,00
3.790	Astronics Corp	Morgan Stanley	2.147	0,00
(158.083)	AT&T Inc	Morgan Stanley	9.827	0,00
(214.628)	ATI Inc	JPMorgan Chase Bank	28.712	0,00
(212.978)	ATI Inc	Goldman Sachs International	25.159	0,00
(37.967)	ATI Inc	Morgan Stanley	5.436	0,00
537	Atlantic Union Bankshares Corp	Morgan Stanley	56	0,00
(18.872)	Atlassian Corp Class A	Goldman Sachs International	5.525	0,00
(24.304)	Atlassian Corp Class A	Morgan Stanley	5.731	0,00
(12.149)	Atlassian Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	1.826	0,00
(5.356)	Aurinia Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	665	0,00
(122.807)	Autodesk Inc	Morgan Stanley	20.983	0,00
1.650.076	Autodesk Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(108)	Autoliv Inc	Morgan Stanley	80	0,00
34.531	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs International	664	0,00
166.732	Automatic Data Processing Inc	JPMorgan Chase Bank	178	0,00
1.126.803	AutoZone Inc	JPMorgan Chase Bank	20.590	0,00
(10)	AvalonBay Communities Inc	Morgan Stanley	23	0,00
(15.500)	Avantor Inc	Morgan Stanley	2.210	0,00
(9.873)	AvePoint Inc	Morgan Stanley	1.707	0,00
(197.990)	Avidity Biosciences Inc	JPMorgan Chase Bank	40.395	0,00
(5.554)	Avidity Biosciences Inc	Goldman Sachs International	1.602	0,00
11.106	AvidXchange Holdings Inc	Morgan Stanley	1.439	0,00
(51)	Avis Budget Group Inc	Morgan Stanley	212	0,00
(53.389)	Aviva Plc	Goldman Sachs International	614	0,00
(87.008)	Avnet Inc	Morgan Stanley	4.086	0,00
(509.153)	AXA SA	Goldman Sachs International	28.504	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
6.407	Axalta Coating Systems Ltd	Morgan Stanley	574	0,00
1.189.894	Axon Enterprise Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(61)	Axos Financial Inc	Morgan Stanley	134	0,00
2.872	B Riley Financial Inc	Morgan Stanley	1.714	0,00
(10)	B2Gold Corp	Morgan Stanley	1	0,00
310	Badger Meter Inc	Morgan Stanley	491	0,00
(233.645)	Baker Hughes Co	Morgan Stanley	3.360	0,00
(614.940)	Baker Hughes Co	JPMorgan Chase Bank	24.438	0,00
(674)	Ball Corp	Morgan Stanley	249	0,00
(93.084)	Banca Mediolanum SpA	Goldman Sachs International	4.335	0,00
6.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	Société Générale	481.665	0,03
204.927	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	Goldman Sachs International	12.250	0,00
205.818	Banco BPM SpA	Goldman Sachs International	3.277	0,00
4.300.000	Banco BPM SpA	Société Générale	365.366	0,02
(1.310.473)	Banco Bradesco SA	Goldman Sachs International	12.088	0,00
38.495	Banco De Sabadell SA	Goldman Sachs International	21.094	0,00
9.000.000	Banco Santander S.A.	Société Générale	654.228	0,04
24	Bank of Montreal	Morgan Stanley	4	0,00
(97.514)	Bank Pekao SA	Morgan Stanley	1.361	0,00
(1.838.020)	Bank Pekao SA	Goldman Sachs International	139.889	0,01
(1.515.056)	Bank Polska Kasa Opieki SA	JPMorgan Chase Bank	145.195	0,01
(43.686)	Barclays Plc	Goldman Sachs International	10.516	0,00
2.573	Barnes Group Inc	Morgan Stanley	4.054	0,00
443.017	Bath & Body Works Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(607.906)	Bath & Body Works Inc	JPMorgan Chase Bank	127.280	0,01
(127.281)	Bath & Body Works Inc	Morgan Stanley	40.896	0,00
650	Bausch + Lomb Corp	Morgan Stanley	789	0,00
(130.636)	Baxter International Inc	Morgan Stanley	8.021	0,00
(6.979)	Baxter International Inc	JPMorgan Chase Bank	364	0,00
351	BCE Inc	Morgan Stanley	12	0,00
66.746	Beam Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	304	0,00
17.068	Beam Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	208	0,00
(1.217)	Beam Therapeutics Inc	Morgan Stanley	1.503	0,00
18.494	Beauty Health Co	JPMorgan Chase Bank	5.528	0,00
9.129	Beauty Health Co	Goldman Sachs International	2.852	0,00
80.601	Becton Dickinson & Co	Morgan Stanley	3.866	0,00
(1.395.736)	BellRing Brands Inc	Goldman Sachs International	849.338	0,05
(311.038)	BellRing Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	72.041	0,01
(490)	Benchmark Electronics Inc	Morgan Stanley	196	0,00
160.047	Berkshire Hathaway Inc Class B	Goldman Sachs International	0	0,00
74.611	Berkshire Hathaway Inc Class B	Morgan Stanley	634	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(1.586)	Berry Global Group Inc	Morgan Stanley	225	0,00
84.853	Best Buy Co Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
456.694	Bidvest Group Ltd	Goldman Sachs International	335	0,00
(141)	BILL Holdings Inc	Morgan Stanley	313	0,00
(69.155)	Bill.com Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	11.274	0,00
13.066	BioCryst Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	3.610	0,00
100	BioCryst Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	21	0,00
(513.377)	Biogen Inc	JPMorgan Chase Bank	22.011	0,00
(197.927)	Biohaven Ltd	Morgan Stanley	139.566	0,01
(43.675)	Biohaven Ltd	Goldman Sachs International	35.954	0,00
244	Bio-Techne Corp	Morgan Stanley	88	0,00
220	BJ's Restaurants Inc	Morgan Stanley	671	0,00
45.741	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Morgan Stanley	2.602	0,00
412.697	BlackRock Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.258)	Block Inc	Morgan Stanley	1.084	0,00
(5.695)	Block Inc	JPMorgan Chase Bank	31	0,00
(36.877)	Block Inc Class A	Goldman Sachs International	17.332	0,00
4.150	Bloomin' Brands Inc	Morgan Stanley	4.697	0,00
2.025	Blue Bird Corp	Morgan Stanley	1.689	0,00
(2.966)	Blueprint Medicines Corp	Goldman Sachs International	502	0,00
(189.465)	Blueprint Medicines Corp	JPMorgan Chase Bank	142.922	0,01
9.200.000	BNP Paribas S.A.	Société Générale	677.195	0,04
(73.369)	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs International	8.195	0,00
(230.299)	Booking Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	28.575	0,00
(191.216)	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	41.699	0,00
2.116	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Morgan Stanley	4.804	0,00
(170)	Borr Drilling Ltd	Morgan Stanley	21	0,00
46.900	Boston Beer Co Inc Class A	Morgan Stanley	4.171	0,00
(455)	Boston Omaha Corp Class A	Morgan Stanley	141	0,00
(128.498)	Boston Properties Inc	Morgan Stanley	34.341	0,00
(778.269)	Boston Scientific Corp	Goldman Sachs International	50.192	0,00
(33.293)	Boston Scientific Corp	JPMorgan Chase Bank	168	0,00
(477.724)	Boyd Gaming Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(203)	Braze Inc Class A	Morgan Stanley	55	0,00
94.469	Braze Inc Class A	Goldman Sachs International	1.261	0,00
(247)	Bread Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	24	0,00
(2.570.585)	Bridgebio Pharma Inc	Nomura	0	0,00
(77.187)	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	8.636	0,00
1.203	Brinker International Inc	Morgan Stanley	1.780	0,00
298.766	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs International	56.121	0,01
9.306	Bristol-Myers Squibb Co	JPMorgan Chase Bank	804	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(218.637)	Broadcom Inc	Morgan Stanley	52.337	0,00
1.222.314	Broadcom Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.051)	Broadstone Net Lease Inc	Morgan Stanley	603	0,00
(705)	Brookfield Asset Management Ltd Class A	Morgan Stanley	55	0,00
4.026	Brown & Brown Inc	Morgan Stanley	3.600	0,00
(1.189)	Brown-Forman Corp Class B	Morgan Stanley	351	0,00
(111.618)	Builders FirstSource Inc	Morgan Stanley	44.126	0,00
(1.117)	Bunge Global S.A.	Morgan Stanley	1.849	0,00
216.599	Bunge Global SA	Goldman Sachs International	2.207	0,00
335.383	Bunge Global SA	JPMorgan Chase Bank	13.644	0,00
419.030	Burberry Group Plc	JPMorgan Chase Bank	118.343	0,01
54.040	Burberry Group Plc	Goldman Sachs International	13.998	0,00
443.283	Bureau Veritas SA	Société Générale	0	0,00
(1.818.349)	Burlington Stores Inc	JPMorgan Chase Bank	153.406	0,01
813	Burlington Stores Inc	Morgan Stanley	2.750	0,00
(690)	BWX Technologies Inc	Morgan Stanley	106	0,00
(73.655)	Cabaletta Bio Inc	Morgan Stanley	39.120	0,00
(31.032)	Cabaletta Bio Inc	Goldman Sachs International	21.439	0,00
3.568	Cactus Inc Class A	Morgan Stanley	841	0,00
(5.638)	Cadence Bank	Morgan Stanley	2.166	0,00
(108.848)	Cadence Design Systems Inc	Morgan Stanley	17.068	0,00
2.541	Cadre Holdings Inc	Morgan Stanley	2.176	0,00
100	CAE Inc	Morgan Stanley	38	0,00
354.458	CaixaBank SA	Goldman Sachs International	43.241	0,00
(100)	Caleres Inc	Morgan Stanley	4	0,00
(2.879)	California Resources Corp	Morgan Stanley	445	0,00
2.230	Calix Inc	Morgan Stanley	2.730	0,00
(5.625)	Callon Petroleum Co	Morgan Stanley	8.990	0,00
(666)	Camden Property Trust	Morgan Stanley	250	0,00
(2.159)	Cameco Corp	Morgan Stanley	97	0,00
943.322	Campbell Soup Co	Goldman Sachs International	3.408	0,00
(677)	Camping World Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	194	0,00
(501)	Canadian Imperial Bank of Commerce	Morgan Stanley	197	0,00
(397.956)	Canadian Natural Resources	JPMorgan Chase Bank	17.424	0,00
(1.379)	Canadian Pacific Kansas City Ltd	Morgan Stanley	810	0,00
(2.001)	Cannae Holdings Inc	Morgan Stanley	517	0,00
231	Capital One Financial Corp	Morgan Stanley	41	0,00
(13.488.238)	Capitec Bank Holdings Ltd	Goldman Sachs International	115.882	0,01
(4.492.939)	Capitec Bank Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	20.230	0,00
1.641.810	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(9.374)	Cargurus Inc	Morgan Stanley	477	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(47.182)	Cargurus Inc	Goldman Sachs International	5.484	0,00
(3.490)	Carlyle Group Inc	Morgan Stanley	141	0,00
(112.853)	Carmax Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
17.599.162	Carnival Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(889)	Carnival Corp	Morgan Stanley	308	0,00
15.400.000	Carnival Corp	Nomura	8.309.590	0,51
(83.861)	Carter's Inc	Morgan Stanley	10.201	0,00
(1.360)	Carvana Co	Morgan Stanley	6.386	0,00
(453.297)	Casey's General Stores Inc	JPMorgan Chase Bank	1.659	0,00
(646.724)	Casey's General Stores Inc	Goldman Sachs International	4.777	0,00
320	CATCHA INVT Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
44	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	13	0,00
(334)	CBRE Group Inc Class A	Morgan Stanley	75	0,00
42.196	CCC Intelligent Solutions Holdings Inc	Morgan Stanley	3.836	0,00
(119.986)	CDW Corp	Morgan Stanley	16.258	0,00
913	CDW Corp	JPMorgan Chase Bank	7	0,00
630.754	CDW Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
7.743.705	Cellnex Telecom SA	Société Générale	864.721	0,06
36.553	Celsius Holdings Inc	Morgan Stanley	2.509	0,00
(73.887)	Celsius Holdings Inc	Goldman Sachs International	4.573	0,00
(445.526)	Celsius Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	21.489	0,00
(2.847)	Cenovus Energy Inc	Morgan Stanley	400	0,00
980.922	Centene Corp	Goldman Sachs International	12.427	0,00
(126.357)	Centene Corp	Morgan Stanley	8.569	0,00
1.479	Cerevel Therapeutics Holdings Inc	Morgan Stanley	1.505	0,00
8.780.472	Ceridian HCM Holding Inc	Nomura	0	0,00
71.888	Ceridian HCM Holding Inc	Morgan Stanley	479	0,00
(119.991)	CF Industries Holdings Inc	Morgan Stanley	7.572	0,00
440.090	ChampionX Corp	JPMorgan Chase Bank	29.719	0,00
666.428	ChampionX Corp	Goldman Sachs International	44.736	0,00
(499.812)	Charles River Laboratories International Inc	Goldman Sachs International	45.610	0,01
285.574	Charles Schwab Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
45.582	Charter Communications Inc Class A	Morgan Stanley	4.100	0,00
10.168	Chegg Inc	Morgan Stanley	2.833	0,00
(82.487)	Chemours Co	Morgan Stanley	14.508	0,00
396.623	Chemours Co	Goldman Sachs International	0	0,00
71.479	Cheniere Energy Inc	Morgan Stanley	9.354	0,00
422.993	Chesapeake Energy Corp	JPMorgan Chase Bank	3.501	0,00
446	Chevron Corp	Goldman Sachs International	2	0,00
677.109	Chevron Corp	JPMorgan Chase Bank	5.055	0,00
(449)	Chevron Corp	Morgan Stanley	1.136	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(43.918)	Chewy Inc Class A	Goldman Sachs International	6.774	0,00
(378.709)	Chewy Inc Class A	Morgan Stanley	94.711	0,01
(96.100)	Chewy Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	19.313	0,00
1.393	Children's Place Inc	Morgan Stanley	36	0,00
2.279.102	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
120.678	Choice Hotels International Inc	JPMorgan Chase Bank	181	0,00
654.232	Choice Hotels International Inc	Morgan Stanley	47.394	0,00
(586.754)	Chord Energy Corp	JPMorgan Chase Bank	29.554	0,00
(921.735)	Church & Dwight Co Inc	JPMorgan Chase Bank	27.712	0,00
(171.082)	Church & Dwight Co Inc	Morgan Stanley	4.998	0,00
(666.297)	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs International	15.194	0,00
19.030	Cie Financiere Richemont SA Class A	JPMorgan Chase Bank	251	0,00
(527.281)	Cigna Group	Goldman Sachs International	6.944	0,00
4.242	Cincinnati Financial Corp	Morgan Stanley	6.635	0,00
27	Cintas Corp	Morgan Stanley	1.196	0,00
(56.171)	Cirrus Logic Inc	Morgan Stanley	4.650	0,00
71.122	Cisco Systems Inc	Morgan Stanley	2.091	0,00
(125.707)	Citigroup Inc	Morgan Stanley	15.828	0,00
4.433	Citizens Financial Group Inc	Morgan Stanley	273	0,00
(5.326)	Civitas Resources Inc	Morgan Stanley	7.265	0,00
(1.196)	Claros Mortgage Trust Inc	Morgan Stanley	671	0,00
3.531	Clearwater Analytics Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	208	0,00
2.949	Clearway Energy Inc Class C	Morgan Stanley	1.855	0,00
(120.591)	Cleveland-Cliffs Inc	Morgan Stanley	31.190	0,00
1.677.111	Cleveland-Cliffs Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
523.365	Clorox Co	JPMorgan Chase Bank	49	0,00
1.640	Clorox Co	Morgan Stanley	1.769	0,00
(17.637)	Cloudflare Inc Class A	Morgan Stanley	1.365	0,00
(28.479)	Cloudflare Inc Class A	Goldman Sachs International	11.170	0,00
73.273	CME Group Inc	Morgan Stanley	332	0,00
(83)	CME Group Inc Class A	Morgan Stanley	209	0,00
3.267	CMS Energy Corp	Morgan Stanley	1.912	0,00
(78.543)	CNA Financial Corp	Morgan Stanley	6.928	0,00
(1.338)	CNO Financial Group Inc	Morgan Stanley	267	0,00
(3.565)	CNX Resources Corp	Morgan Stanley	317	0,00
229	Coca-Cola Co	Morgan Stanley	26	0,00
1.296	Cognex Corp	Morgan Stanley	103	0,00
2.009	Coinbase Global Inc Class A	Morgan Stanley	18.359	0,00
422	Collegium Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	243	0,00
(70.977)	Columbia Banking System Inc	Morgan Stanley	27.269	0,00
(1.692)	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	4.218	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(304.392)	Comcast Corp Class A	Morgan Stanley	17.454	0,00
60.148	Comcast Corp Class A	Goldman Sachs International	1.143	0,00
(84.057)	Comerica Inc	Morgan Stanley	20.137	0,00
(212.932)	Commercial Metals Co	Goldman Sachs International	0	0,00
2.141	CommVault Systems Inc	Morgan Stanley	455	0,00
(9.229)	Compass Inc Class A	Morgan Stanley	13.232	0,00
67.947	Comstock Resources Inc	JPMorgan Chase Bank	12.518	0,00
(71.265)	Concentrix Corp	Morgan Stanley	17.196	0,00
3.573.562	Confluent Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(922.552)	CONMED Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(3.476)	ConocoPhillips	Morgan Stanley	6.030	0,00
(817.107)	ConocoPhillips	JPMorgan Chase Bank	10.937	0,00
(1.082.336)	Constellation Brands Inc Class A	Goldman Sachs International	70.375	0,01
214	Constellation Brands Inc Class A	Morgan Stanley	1.055	0,00
32.700	Constellation Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(267.937)	Cooper Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	17.030	0,00
4.134	Copart Inc	Goldman Sachs International	6	0,00
1.821	COPT Defense Properties	Morgan Stanley	72	0,00
3.625	Corcept Therapeutics Inc	Morgan Stanley	4.400	0,00
1.659	Core & Main Inc Class A	Morgan Stanley	230	0,00
(77.373)	Corebridge Financial Inc	Morgan Stanley	7.044	0,00
(195.837)	Corp ACCIONA Energias Renovables SA	Goldman Sachs International	23.489	0,00
(1.023)	Corsair Gaming Inc	Morgan Stanley	349	0,00
80.201	Corteva Inc	Morgan Stanley	2.893	0,00
(789)	Costco Wholesale Corp	Morgan Stanley	2.900	0,00
(264.694)	Coterra Energy Inc	Goldman Sachs International	809	0,00
364.141	Coterra Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	20.640	0,00
(23.329)	Coty Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	3.851	0,00
(38.226)	Coty Inc Class A	Goldman Sachs International	11.371	0,00
(27.707)	Coupang Inc	Goldman Sachs International	365	0,00
(15.496)	Coupang Inc	Morgan Stanley	58	0,00
3.444	Cousins Properties Inc	Morgan Stanley	575	0,00
(241.882)	CPFL Energia SA	Goldman Sachs International	8.137	0,00
16	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Morgan Stanley	1	0,00
100	Crane Co	Morgan Stanley	537	0,00
9.100.000	Credit Agricole S.A.	Société Générale	384.371	0,03
6.020	Credo Technology Group Holding Ltd	Morgan Stanley	308	0,00
(536.591)	CRH Plc	JPMorgan Chase Bank	48.494	0,01
148.810	CRISPR Therapeutics AG	Goldman Sachs International	9.102	0,00
(1.099.363)	Crocs Inc	Morgan Stanley	86.165	0,01
1.838	Crown Castle Inc	JPMorgan Chase Bank	11	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
65.008	Crown Castle Inc	Goldman Sachs International	834	0,00
(23)	Crown Holdings Inc	Morgan Stanley	19	0,00
(583)	CryoPort Inc	Morgan Stanley	253	0,00
223	CS Disco Inc	Morgan Stanley	28	0,00
189	CSG Systems International Inc	Morgan Stanley	42	0,00
(765)	CubeSmart	Morgan Stanley	221	0,00
1.265	Curtiss-Wright Corp	Morgan Stanley	4.909	0,00
2.461	Cushman & Wakefield Plc	Morgan Stanley	283	0,00
(926)	Custom Truck One Source Inc	Morgan Stanley	113	0,00
429.611	CVR Energy Inc	Goldman Sachs International	28.494	0,00
408.226	CVR Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	39.105	0,00
(34.926)	CVS Health Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(259)	CVS Health Corp	Morgan Stanley	9	0,00
236.899.016	CyberAgent Inc	Nomura	0	0,00
(107.428)	CyberArk Software Ltd	JPMorgan Chase Bank	11.627	0,00
(82)	CyberArk Software Ltd	Morgan Stanley	67	0,00
(210.122)	Cymabay Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	45.032	0,00
(284.751)	Cymabay Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	59.684	0,00
(8.272)	Cytek Biosciences Inc	Morgan Stanley	2.155	0,00
(3.275)	Cytokinetics Inc	Goldman Sachs International	4.892	0,00
367.843.500	Daifuku Co Ltd	Société Générale	0	0,00
(1.436)	Dana Inc	Morgan Stanley	162	0,00
(1.787.516)	Danske Bank A/S	Goldman Sachs International	23.212	0,00
360	Darling Ingredients Inc	Morgan Stanley	20	0,00
(151)	Datadog Inc Class A	Morgan Stanley	217	0,00
910.764	Dave & Buster's Entertainment Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(19)	Dave & Buster's Entertainment Inc	Morgan Stanley	1	0,00
390.080	Davide Campari-Milano NV	Société Générale	0	0,00
144	DaVita Inc	Morgan Stanley	9	0,00
(1.670.931)	Deere & Co	JPMorgan Chase Bank	64.952	0,01
(641.764)	Deere & Co	Goldman Sachs International	2.810	0,00
(213.863)	Deere & Co	Morgan Stanley	3.475	0,00
179.645	Delek US Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	6.690	0,00
279.776	Delek US Holdings Inc	Goldman Sachs International	13.672	0,00
(2.638)	Delek US Holdings Inc	Morgan Stanley	2.278	0,00
(187.935)	Dell Technologies Inc Class C	Morgan Stanley	30.789	0,00
(613.768)	Delta Air Lines Inc	JPMorgan Chase Bank	44.393	0,00
70.194	Denali Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	1.550	0,00
4.136	Denny's Corp	Morgan Stanley	1.425	0,00
(527)	DENTSPLY SIRONA Inc	Morgan Stanley	6	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(181.654)	Deutsche Bank AG	Goldman Sachs International	26.964	0,00
10.000.000	Deutsche Lufthansa AG	Société Générale	1.124.413	0,07
2.208.921	Deutsche Lufthansa AG	Goldman Sachs International	0	0,00
38.396.775	Deutsche Telekom AG	Goldman Sachs International	0	0,00
(869.609)	Devon Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(641.178)	Devon Energy Corp	JPMorgan Chase Bank	9.190	0,00
(71.291)	Dexcom Inc	JPMorgan Chase Bank	31.242	0,00
(102.598)	Dexcom Inc	Morgan Stanley	34.155	0,00
608.085	Dexcom Inc	Goldman Sachs International	4.944	0,00
674.044	Diageo Plc	JPMorgan Chase Bank	17.824	0,00
754.923	Diamondback Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	10.254	0,00
(379)	Diamondback Energy Inc	Morgan Stanley	1.508	0,00
3.161.715	Dick's Sporting Goods Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.652	DigitalBridge Group Inc	Morgan Stanley	523	0,00
(1.146)	Discount Medicine Inc	Morgan Stanley	418	0,00
(3.227.805)	Discovery Ltd	JPMorgan Chase Bank	6.072	0,00
(478.259)	DISH Network Corp Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(118.258)	DocuSign Inc	Morgan Stanley	52.767	0,01
(610.479)	Dollar General Corp	JPMorgan Chase Bank	22.976	0,00
522	Dollar General Corp	Morgan Stanley	2.561	0,00
72.641	Dollar Tree Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(902.212)	Dollar Tree Inc	JPMorgan Chase Bank	43.246	0,00
(7.926)	Dominion Energy Inc	Morgan Stanley	4.315	0,00
1.052.749	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.822)	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	692	0,00
3.781	Domo Inc Class B	Morgan Stanley	1.094	0,00
(83.604)	Donaldson Co Inc	Morgan Stanley	8.159	0,00
898	Donnelley Financial Solutions Inc	Morgan Stanley	572	0,00
(1.880)	DoorDash Inc Class A	Morgan Stanley	2.688	0,00
(569)	Dorian LPG Ltd	Morgan Stanley	697	0,00
(92.200)	DoubleVerify Holdings Inc	Morgan Stanley	11.992	0,00
(3.942)	Douglas Emmett Inc	Morgan Stanley	2.684	0,00
271	Dover Corp	Morgan Stanley	8	0,00
(2.057)	Dow Inc	Morgan Stanley	970	0,00
1.167	Doximity Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	4	0,00
3.609	Doximity Inc Class A	Morgan Stanley	2.186	0,00
(211.094)	DR Horton Inc	Morgan Stanley	5.150	0,00
15.486	DraftKings Inc Class A	Morgan Stanley	6.762	0,00
9.261	Driven Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	1.225	0,00
2.286	DT Midstream Inc	Morgan Stanley	1.347	0,00
100	Ducommun Inc	Morgan Stanley	17	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(81)	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Morgan Stanley	6	0,00
(155.193)	Dynatrace Inc	Morgan Stanley	17.732	0,00
(38.176)	Dyne Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	29.561	0,00
(13.518)	Dyne Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	11.131	0,00
(188.249)	Dyne Therapeutics Inc	Morgan Stanley	34.319	0,00
(9.414)	Dynex Capital Inc	Morgan Stanley	2.185	0,00
(220.061)	E.On SE	Goldman Sachs International	21.229	0,00
(76.913)	Eagle Materials Inc	Morgan Stanley	18.760	0,00
438.800	Eagle Materials Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(68.568)	East West Bancorp Inc	Morgan Stanley	28.562	0,00
(1.881)	Easterly Government Properties Inc	Morgan Stanley	145	0,00
(320.051)	Eaton Corp Plc	Goldman Sachs International	3.226	0,00
(1.067.482)	Eaton Corp Plc	Morgan Stanley	19.432	0,00
(506.105)	Eaton Corp Plc	JPMorgan Chase Bank	13.585	0,00
(124.955)	eBay Inc	Morgan Stanley	9.042	0,00
2.986	eBay Inc	Goldman Sachs International	3	0,00
1.693	Ecolab Inc	Morgan Stanley	3.469	0,00
1.414	Edison International	Morgan Stanley	2.674	0,00
(449)	Editas Medicine Inc	Morgan Stanley	131	0,00
115.446	EDP-Energias De Portugal	Goldman Sachs International	1.116	0,00
135.905	Edwards Lifesciences Corp	Goldman Sachs International	21.976	0,00
1.746	El Pollo Loco Holdings Inc	Morgan Stanley	18	0,00
1.124	Elastic NV	Morgan Stanley	1.796	0,00
(556)	Eldorado Gold Corp	Morgan Stanley	131	0,00
(110.910)	Electronic Arts Inc	Morgan Stanley	15.665	0,00
(791.358)	Eletrobras De Brazil	Goldman Sachs International	18.073	0,00
(118.997)	Elevance Health Inc	Morgan Stanley	18.554	0,00
(492.103)	elf Beauty Inc	JPMorgan Chase Bank	72.227	0,01
(39.030)	elf Beauty Inc	Morgan Stanley	5.549	0,00
(411.143)	elf Beauty Inc	Goldman Sachs International	107.175	0,01
(483.628)	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs International	30.790	0,00
(85.246)	Eli Lilly & Co	Morgan Stanley	19.345	0,00
(1.677)	Ellington Financial Inc	Morgan Stanley	246	0,00
5.400.000	ELM BV for Swiss Prime Site AG	Société Générale	816.004	0,05
15.800.000	ELM BV for Swiss Re Ltd	Société Générale	1.341.797	0,08
14.601	Elme Communities	Morgan Stanley	781	0,00
8.803	Embecta Corp	Morgan Stanley	4.697	0,00
(83.040)	EMCOR Group Inc	Morgan Stanley	3.590	0,00
(127.447)	Emerson Electric Co	Morgan Stanley	13.291	0,00
8.722	Enbridge Inc	Morgan Stanley	520	0,00
558	Encompass Health Corp	Morgan Stanley	285	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
291.871	Endesa SA	Goldman Sachs International	1.650	0,00
(138.973)	Enel SpA	Goldman Sachs International	16.276	0,00
319.487	Energizer Holdings Inc	Goldman Sachs International	9.742	0,00
674.543	Energizer Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	29.619	0,00
(2.124)	Energizer Holdings Inc	Morgan Stanley	158	0,00
(2.065)	Enerpac Tool Group Corp	Morgan Stanley	561	0,00
(312.784)	Engie SA	Goldman Sachs International	8.126	0,00
3.920.548	Eni SpA	Société Générale	0	0,00
11.600.000	Eni SpA	Nomura	1.042.691	0,07
276.003	EnLink Midstream LLC	Morgan Stanley	6.266	0,00
467.405	EnLink Midstream LLC	Goldman Sachs International	25.190	0,00
702	Enova International Inc	Morgan Stanley	464	0,00
832.122	Enovis Corp	Nomura	0	0,00
(2.195)	Enovix Corp	Morgan Stanley	3.070	0,00
(25.150)	Enphase Energy Inc	Morgan Stanley	7.979	0,00
(107.776)	Entergy Corp	Morgan Stanley	19.058	0,00
(259.000)	Envestnet Inc	Nomura	0	0,00
2.751	Envestnet Inc	Morgan Stanley	1.336	0,00
409	Enviri Corp	Morgan Stanley	20	0,00
(240.555)	Envista Holdings Corp	Goldman Sachs International	3.322	0,00
65.540	EOG Resources Inc	JPMorgan Chase Bank	1.247	0,00
455.836	EOG Resources Inc	Goldman Sachs International	5.423	0,00
754	EPAM Systems Inc	Morgan Stanley	2.357	0,00
(10.428)	EPR Properties	Morgan Stanley	960	0,00
25.270	EQT Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(90.969)	EQT Corp	Morgan Stanley	6.909	0,00
(245.164)	Equifax Inc	JPMorgan Chase Bank	91.761	0,01
(78.828)	Equifax Inc	Goldman Sachs International	25.107	0,00
(42.813)	Equifax Inc	Morgan Stanley	3.243	0,00
3.966.872	Equinor ASA	Goldman Sachs International	14.296	0,00
6.225.514	Equinor ASA	JPMorgan Chase Bank	56.227	0,01
(11.981)	Equity Commonwealth	Morgan Stanley	503	0,00
(1.512)	Equity LifeStyle Properties Inc	Morgan Stanley	880	0,00
7.600.000	Erste Group Bank AG	Société Générale	452.871	0,03
(77.226)	Erste Group Bank AG	Goldman Sachs International	7.327	0,00
(217.763)	Erste Group Bank AG	JPMorgan Chase Bank	19.865	0,00
2.572	Essent Group Ltd	Morgan Stanley	1.207	0,00
(111.224)	Essential Utilities Inc	Morgan Stanley	17.577	0,00
(310.455)	Estee Lauder Cos Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	1.106	0,00
(259.778)	Estee Lauder Cos Inc Class A	Morgan Stanley	19.211	0,00
(167.625)	Etsy Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(37)	Etsy Inc	Morgan Stanley	30	0,00
(58.052)	Euronet Worldwide Inc	Morgan Stanley	9.506	0,00
2.421	European Wax Center Inc Class A	Morgan Stanley	41	0,00
562	Evercore Inc Class A	Morgan Stanley	1.882	0,00
(113.260)	Evergy Inc	Morgan Stanley	9.197	0,00
1.286	EVERTEC Inc	Morgan Stanley	69	0,00
(653.881)	Evolent Health Inc Class A	Goldman Sachs International	119.900	0,01
100	EW Scripps Co Class A	Morgan Stanley	48	0,00
2.930	Exact Sciences Corp	Morgan Stanley	13.408	0,00
(105.842)	Exelixis Inc	Goldman Sachs International	18.970	0,00
(37.942)	Exelixis Inc	Morgan Stanley	6.168	0,00
(94.547)	Exelixis Inc	JPMorgan Chase Bank	11.276	0,00
72.809	Exelon Corp	Morgan Stanley	4.964	0,00
3.755	ExlService Holdings Inc	Morgan Stanley	1.169	0,00
24.387	Expedia Group Inc	Goldman Sachs International	110	0,00
(93.028)	Expedia Group Inc	Morgan Stanley	48.586	0,01
(836)	Expro Group Holdings NV	Morgan Stanley	339	0,00
(237)	Extra Space Storage Inc	Morgan Stanley	137	0,00
2.377.675	Exxon Mobil Corp	JPMorgan Chase Bank	41.252	0,00
73.298	Exxon Mobil Corp	Morgan Stanley	3.281	0,00
722.190	Fair Isaac Corp	Goldman Sachs International	29.035	0,00
(84.251)	Fair Isaac Corp	JPMorgan Chase Bank	1.811	0,00
(21.413)	Fair Isaac Corp	Morgan Stanley	684	0,00
(10.122)	Farmland Partners Inc	Morgan Stanley	3.471	0,00
2.146	FARO Technologies Inc	Morgan Stanley	1.911	0,00
(1.178)	Fastenal Co	Morgan Stanley	508	0,00
(1.066)	Fastly Inc Class A	Morgan Stanley	607	0,00
9.989	Fathom Digital Manufacturing Corporation	Goldman Sachs International	0	0,00
56	Federal Agricultural Mortgage Corp	Morgan Stanley	251	0,00
1.024	Federal Signal Corp	Morgan Stanley	224	0,00
938.588	FedEx Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.481	Ferguson Plc	Morgan Stanley	5.790	0,00
(168)	Ferrari NV	Morgan Stanley	505	0,00
6.318	Fidelity National Financial Inc	Morgan Stanley	6.366	0,00
(151.050)	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	7.376	0,00
(112.450)	Fifth Third Bancorp	Morgan Stanley	39.059	0,00
(101)	First Citizens BancShares Inc Class A	Morgan Stanley	532	0,00
820	First Foundation Inc	Morgan Stanley	453	0,00
1.036	First Hawaiian Inc	Morgan Stanley	63	0,00
9.750	First Horizon Corp	Morgan Stanley	1.777	0,00
(81.043)	First Industrial Realty Trust Inc	Morgan Stanley	12.717	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(4.588)	First Interstate BancSystem Inc Class A	Morgan Stanley	2.417	0,00
(1.771)	First Majestic Silver Corp	Morgan Stanley	125	0,00
(701.733)	First Solar Inc	JPMorgan Chase Bank	33.401	0,00
(88.310)	First Solar Inc	Morgan Stanley	13.438	0,00
75.083	FirstEnergy Corp	Morgan Stanley	625	0,00
(971)	Fiserv Inc	Morgan Stanley	422	0,00
(849)	Five Below Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(392.488)	Five Below Inc	JPMorgan Chase Bank	62.807	0,01
532	Five9 Inc	Morgan Stanley	367	0,00
120	FleetCor Technologies Inc	Morgan Stanley	701	0,00
(290.880)	Flex Ltd	Morgan Stanley	44.169	0,00
(3.095)	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	2.444	0,00
(352)	Flowers Foods Inc	Morgan Stanley	2	0,00
354.544	Flowers Foods Inc	Goldman Sachs International	54.458	0,01
(85.546)	Flowserve Corp	Morgan Stanley	6.075	0,00
2.331	Fluence Energy Inc	Morgan Stanley	883	0,00
(592.666)	Fluor Corp	Nomura	0	0,00
(329.725)	Flutter Entertainment Plc	Goldman Sachs International	27.453	0,00
(32.791)	Flutter Entertainment Plc	JPMorgan Chase Bank	3.894	0,00
(70.923)	Flutter Entertainment Plc	Morgan Stanley	8.566	0,00
2.096	FMC Corp	Morgan Stanley	5.475	0,00
(5.396)	FNB Corp	Morgan Stanley	700	0,00
(389.883)	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	Goldman Sachs International	33.091	0,00
(396.560)	Fomento Economico Mexicano SAB de CV	JPMorgan Chase Bank	6.365	0,00
(145.172)	Foot Locker Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.263)	Foot Locker Inc	Morgan Stanley	733	0,00
(4.627.089)	Foran Mining Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(434)	Forestar Group Inc	Morgan Stanley	591	0,00
(78.021)	Fortinet Inc	Morgan Stanley	13.854	0,00
209.122	Fortinet Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(78.330)	Fortrea Holdings Inc	Morgan Stanley	20.828	0,00
(2.334)	Fortune Brands Home & Security Inc	Morgan Stanley	3.111	0,00
(5.206.492)	Foschini Group Ltd	Goldman Sachs International	39.204	0,00
(1.523.984)	Foschini Group Ltd	Morgan Stanley	17.892	0,00
(1.340.423)	Foschini Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	13.192	0,00
(1.295)	Four Corners Property Trust Inc	Morgan Stanley	35	0,00
54.960	Fox Corp Class A	Morgan Stanley	8.286	0,00
220	Franklin Covey Co	Morgan Stanley	415	0,00
1.030	Franklin Electric Co Inc	Morgan Stanley	565	0,00
(182.434)	Freeport-McMoRan Inc	Goldman Sachs International	87.938	0,01
(330.025)	Freeport-McMoRan Inc	JPMorgan Chase Bank	2.702	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(91.923)	Freshpet Inc	Morgan Stanley	12	0,00
(338.709)	Freshpet Inc	JPMorgan Chase Bank	28.858	0,00
(1.288.273)	Freshpet Inc	Goldman Sachs International	322.557	0,02
(2.014)	Freshworks Inc Class A	Morgan Stanley	978	0,00
567	Frontier Group Holdings Inc	Morgan Stanley	114	0,00
(289)	FTAI Aviation Ltd	Morgan Stanley	108	0,00
(10.551)	Fulcrum Therapeutics Inc	Morgan Stanley	6.446	0,00
(39.440)	Fulcrum Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	31.457	0,00
(43.645)	Fulcrum Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	16.195	0,00
(572)	Fulgent Genetics Inc	Morgan Stanley	255	0,00
(3.182)	Fulton Financial Corp	Morgan Stanley	675	0,00
(56.920)	GameStop Corp Class A	Morgan Stanley	23.729	0,00
(658.699)	Gap Inc	JPMorgan Chase Bank	35.602	0,00
(784)	Garmin Ltd	Morgan Stanley	51	0,00
771	Garrett Motion Inc	Morgan Stanley	1.070	0,00
(51.763)	Gartner Inc	JPMorgan Chase Bank	14.403	0,00
(69.541)	Gates Industrial Corp Plc	Morgan Stanley	14.231	0,00
(124.865)	GE HealthCare Technologies Inc	Morgan Stanley	18.693	0,00
(97.341)	Gen Digital Inc	Morgan Stanley	31.768	0,00
228	Generac Holdings Inc	Morgan Stanley	57	0,00
947	General Electric Co	Morgan Stanley	2.170	0,00
2.352	General Mills Inc	Morgan Stanley	1.350	0,00
(2.086.919)	General Motors Co	Morgan Stanley	19.839	0,00
449	Genesco Inc	Morgan Stanley	545	0,00
87.219	Genmab A/S	Goldman Sachs International	17.089	0,00
1.442	Genpact Ltd	Morgan Stanley	126	0,00
(9)	Gentex Corp	Morgan Stanley	2	0,00
67	G-III Apparel Group Ltd	Morgan Stanley	23	0,00
937	Gildan Activewear Inc	Morgan Stanley	321	0,00
(42.473)	Gilead Sciences Inc	Morgan Stanley	3.373	0,00
3.009	Gitlab Inc Class A	Morgan Stanley	916	0,00
(916)	Glacier Bancorp Inc	Morgan Stanley	889	0,00
(973)	Glaukos Corp	Morgan Stanley	715	0,00
(1.791)	Global Medical REIT Inc	Morgan Stanley	196	0,00
(145.618)	Global Payments Inc	Morgan Stanley	16.544	0,00
(79.036)	Global-e Online Ltd	Goldman Sachs International	21.440	0,00
19.839	GlobalFoundries Inc	Morgan Stanley	707	0,00
1.806	Globus Medical Inc Class A	Morgan Stanley	1.664	0,00
(126.232)	GoDaddy Inc Class A	Morgan Stanley	10.301	0,00
(68.671)	GoDaddy Inc Class A	Goldman Sachs International	29.127	0,00
(118.004)	Goldman Sachs Group Inc	Morgan Stanley	31.419	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(467)	Graco Inc	Morgan Stanley	42	0,00
(72.822)	Grand Canyon Education Inc	Morgan Stanley	8.684	0,00
(531.858)	Grifols SA	Goldman Sachs International	260.332	0,02
(560.350)	Grifols SA	JPMorgan Chase Bank	87.660	0,01
875.378	Grocery Outlet Holding Corp	JPMorgan Chase Bank	39.751	0,00
42.205	Grocery Outlet Holding Corp	Morgan Stanley	2.564	0,00
(1.758.997)	Group 1 Automotive Inc	Morgan Stanley	507.815	0,03
(433.217)	GSK Plc	JPMorgan Chase Bank	3.022	0,00
(682.162)	GSK Plc	Goldman Sachs International	7.350	0,00
911.125	Guardant Health Inc	Nomura	0	0,00
829	Guidewire Software Inc	Morgan Stanley	2.001	0,00
(1.526)	GXO Logistics Inc	Morgan Stanley	718	0,00
246.357	H Lundbeck A/S	Goldman Sachs International	1.458	0,00
(71.119)	H&R Block Inc	Morgan Stanley	17.626	0,00
4.988	Hain Celestial Group Inc	Morgan Stanley	1.990	0,00
124.159	Halliburton Co	Goldman Sachs International	7.391	0,00
(100.410)	Halliburton Co	Morgan Stanley	5.470	0,00
18.226	Halliburton Co	JPMorgan Chase Bank	54	0,00
73.102	Halozyme Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	5.606	0,00
1.230	Halozyme Therapeutics Inc	Morgan Stanley	6	0,00
(189)	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc	Morgan Stanley	153	0,00
282.878	Hannover Rueckversicheru SE	Goldman Sachs International	1.398	0,00
(70.502)	Harley-Davidson Inc	Morgan Stanley	31.104	0,00
515	Harmonic Inc	Morgan Stanley	424	0,00
272	Harrow Inc	Morgan Stanley	270	0,00
8.157	HashiCorp Inc Class A	Morgan Stanley	5.003	0,00
2.594	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	11.755	0,00
100	Health Catalyst Inc	Morgan Stanley	7	0,00
2.272	Healthcare Services Group Inc	Morgan Stanley	460	0,00
(122.731)	Healthpeak Properties Inc	Morgan Stanley	16.897	0,00
192	HealthStream Inc	Morgan Stanley	112	0,00
324.497	Helmerich & Payne	Goldman Sachs International	10.158	0,00
321.470	Helmerich & Payne	JPMorgan Chase Bank	12.309	0,00
(282)	Helmerich & Payne Inc	Morgan Stanley	70	0,00
(169)	Henry Schein Inc	Morgan Stanley	89	0,00
(695.633)	Henry Schein Inc	Goldman Sachs International	37.870	0,00
191	Herbalife Ltd	Morgan Stanley	0	0,00
3.585.000	Herbalife Ltd	Nomura	403.166	0,03
1.780.290	Herbalife Nutrition Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
4.198	Hershey Co	Morgan Stanley	22.213	0,00
354.465	Hershey Co	JPMorgan Chase Bank	4.539	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(80.905)	Hertz Global Holdings Inc	Morgan Stanley	15.220	0,00
747.009	Hess Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
9.712	Hess Midstream LP Class A	Morgan Stanley	1.308	0,00
25.292	Hewlett Packard Enterprise Co	Morgan Stanley	118	0,00
2.163	Hexcel Corp	Morgan Stanley	2.195	0,00
(131.478)	HF Sinclair Corp	Morgan Stanley	1.238	0,00
(92.525)	Highwoods Properties Inc	Morgan Stanley	22.432	0,00
(1.068)	Hillman Solutions Corp	Morgan Stanley	69	0,00
3.050	Hilltop Holdings Inc	Morgan Stanley	1.989	0,00
(596)	Hilton Grand Vacations Inc	Morgan Stanley	546	0,00
3.618	Hilton Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	12.107	0,00
(11.113)	Hims & Hers Health Inc	Morgan Stanley	3.013	0,00
(52.616)	Hims & Hers Health Inc	Goldman Sachs International	18.090	0,00
(27.409)	Hims & Hers Health Inc	JPMorgan Chase Bank	3.528	0,00
4.662	Hologic Inc	Morgan Stanley	3.132	0,00
(985)	Home BancShares Inc	Morgan Stanley	156	0,00
(121.662)	Home Depot Inc	Morgan Stanley	20.014	0,00
488.195	Home Reit Plc	Bank of America Merrill Lynch	622	0,00
183	Honeywell International Inc	Morgan Stanley	318	0,00
4.307	Hope Bancorp Inc	Morgan Stanley	214	0,00
87.626	Hormel Foods Corp	Morgan Stanley	10.350	0,00
54.767.340	Hosiden Corp	Société Générale	0	0,00
(128)	Houlihan Lokey Inc	Morgan Stanley	59	0,00
(86.620)	Howard Hughes Holdings Inc	Morgan Stanley	15.116	0,00
(1.010.001)	Howmet Aerospace Inc	JPMorgan Chase Bank	84.005	0,01
(311.220)	Howmet Aerospace Inc	Morgan Stanley	6.715	0,00
(316.171)	Howmet Aerospace Inc	Goldman Sachs International	13.385	0,00
391.668	HP Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(123.751)	HP Inc	Morgan Stanley	4.448	0,00
854	Hubbell Inc	Morgan Stanley	5.654	0,00
(82.748)	HubSpot Inc	JPMorgan Chase Bank	23.308	0,00
1.709	Humana Inc	Morgan Stanley	4.791	0,00
34.662	Humana Inc	JPMorgan Chase Bank	3.142	0,00
(110.051)	Huntington Ingalls Industries	Morgan Stanley	31.425	0,00
440	Huntington Ingalls Industries Inc	Morgan Stanley	2.288	0,00
(45.187)	Huntsman Corp	Morgan Stanley	2.663	0,00
(253)	Hyatt Hotels Corp Class A	Morgan Stanley	34	0,00
100	I3 Verticals Inc Class A	Morgan Stanley	1	0,00
54.800	ICU Medical Inc	Morgan Stanley	5.726	0,00
510	IDEX Corp	Morgan Stanley	1.951	0,00
(115.258)	IDEXX Laboratories Inc	Morgan Stanley	43.265	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
5.028.110	Idorsia Ltd	Société Générale	394.507	0,03
(100)	IMAX Corp	Morgan Stanley	14	0,00
(178.591)	Immunocore Holdings Plc	JPMorgan Chase Bank	41.814	0,00
(90.313)	Immunocore Holdings Plc	Goldman Sachs International	7.369	0,00
(162.943)	Immunocore Holdings Plc	Morgan Stanley	49.250	0,01
(139.165)	Imperial Oil Ltd	Goldman Sachs International	480	0,00
715.420	Imperial Oil Ltd	Morgan Stanley	5.884	0,00
414.630	Imperial Oil Ltd	JPMorgan Chase Bank	2.372	0,00
546	Inari Medical Inc	Morgan Stanley	714	0,00
(42.707)	Incyte Corp	Morgan Stanley	9.085	0,00
(8.072)	Independence Realty Trust Inc	Morgan Stanley	336	0,00
111	Independent Bank Group Inc	Morgan Stanley	96	0,00
(319.593)	ING Groep NV	Goldman Sachs International	44.854	0,01
(84.851)	Ingredion Inc	Morgan Stanley	6.120	0,00
(24.744)	Ingredion Inc	JPMorgan Chase Bank	2.461	0,00
(81.752)	Ingredion Inc	Goldman Sachs International	6.423	0,00
(10.360)	Inhibrx Inc	Goldman Sachs International	14.652	0,00
(63.122)	Inhibrx Inc	JPMorgan Chase Bank	55.907	0,01
606	Innovid Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(175)	Insight Enterprises Inc	Morgan Stanley	837	0,00
(166.759)	Insmed Inc	Morgan Stanley	76.489	0,01
4.000.000	Insmed Inc	Nomura	1.194.881	0,08
(20.502)	Insmed Inc	Goldman Sachs International	3.580	0,00
1.980	Insperity Inc	Morgan Stanley	987	0,00
83	Inspire Medical Systems Inc	Morgan Stanley	1.120	0,00
(150.537)	Insulet Corp	Morgan Stanley	44.277	0,00
(14.673)	Insulet Corp	JPMorgan Chase Bank	13	0,00
1.903.432	Insulet Corp	Nomura	0	0,00
(294.335)	Insulet Corp	Goldman Sachs International	41.730	0,00
1.485	Insulet Corp	Morgan Stanley	9.611	0,00
(79.497)	Integra Lifesciences Holding	Morgan Stanley	12.922	0,00
2.829	Integra LifeSciences Holdings Corp	Morgan Stanley	183	0,00
(43.712)	Intel Corp	Morgan Stanley	19.673	0,00
(228.134)	Inter Parfums Inc	Goldman Sachs International	6.688	0,00
(39.373)	Inter Parfums Inc	Morgan Stanley	3.816	0,00
(254.861)	Inter Parfums Inc	JPMorgan Chase Bank	3.844	0,00
(84.542)	Interactive Brokers Group Inc Class A	Morgan Stanley	6.776	0,00
(97.545)	Intercontinental Exchange Inc	Morgan Stanley	8.986	0,00
(206.422)	Intercontinental Exchange Inc	Goldman Sachs International	28.686	0,00
(379.509)	Intercontinental Exchange Inc	JPMorgan Chase Bank	50.440	0,01
7.482.526	InterDigital Inc	Goldman Sachs International	0	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
6.300.000	InterDigital Inc	Nomura	1.831.355	0,11
(634)	InterDigital Inc	Morgan Stanley	1.172	0,00
4.136.499	International Consolidated Airlines Group SA	Société Générale	453.056	0,03
(124.520)	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs International	25.984	0,00
(339.747)	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	67.701	0,01
(1.125)	International Paper Co	Morgan Stanley	367	0,00
(5.188)	International Seaways Inc	Morgan Stanley	6.035	0,00
(1.596)	Interpublic Group of Cos Inc	Morgan Stanley	281	0,00
11.200.000	Intesa Sanpaolo SpA	Société Générale	208.350	0,02
(61.777)	Intra-Cellular Therapies Inc	JPMorgan Chase Bank	6.795	0,00
(19.151)	Intuit Inc	Morgan Stanley	1.442	0,00
(8.913)	Intuit Inc	Goldman Sachs International	1.696	0,00
(56.443)	Intuit Inc	JPMorgan Chase Bank	16.569	0,00
(67.968)	Ionis Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	516	0,00
(1.004.925)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	37.853	0,00
(3.534)	IonQ Inc	Morgan Stanley	5.126	0,00
(815.720)	IQVIA Holdings Inc	Goldman Sachs International	44.519	0,00
3.628	Iridium Communications Inc	Morgan Stanley	3.787	0,00
(125.859)	Iron Mountain Inc	Morgan Stanley	13.342	0,00
19.412	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	7.082	0,00
966.746	Italgas SpA	Société Générale	0	0,00
(1.164.729)	Itau Unibanco Holding SA	Goldman Sachs International	13.412	0,00
2.437	Itron Inc	Morgan Stanley	1.853	0,00
1.539.580	ITT Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(5.012)	Ivanhoe Electric Inc	Morgan Stanley	1.898	0,00
(1.958)	Jabil Inc	Morgan Stanley	5.381	0,00
(2.937)	Jackson Financial Inc Class A	Morgan Stanley	3.043	0,00
123.495.259	JAFCO Group Co Ltd	Nomura	0	0,00
(15.733)	Janus Henderson Group Plc	Morgan Stanley	5.139	0,00
12.004	Jaws Mustang	Goldman Sachs International	0	0,00
(77)	JB Hunt Transport Services Inc	Morgan Stanley	174	0,00
(5.487)	JBG SMITH Properties	Morgan Stanley	1.211	0,00
66.027	JD.com Inc	Morgan Stanley	12.172	0,00
(18.999.600)	JD.com Inc Class A	Morgan Stanley	0	0,00
(73.485)	Jefferies Financial Group Inc	Morgan Stanley	27.657	0,00
372.885.710	JFE Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.229.720)	JM Smucker Co	Morgan Stanley	146.074	0,01
(1.078.642)	JM Smucker Co	Goldman Sachs International	56.422	0,00
(503.148)	JM Smucker Co	JPMorgan Chase Bank	51.408	0,01
(808.206)	Johnson & Johnson	Goldman Sachs International	23.446	0,00
528.977	Johnson & Johnson	Morgan Stanley	3.977	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
2.503	Kaman Corp	Morgan Stanley	799	0,00
(83.769)	KBC Group NV	Goldman Sachs International	4.955	0,00
653	Kellanova	Morgan Stanley	37	0,00
1.983	Kemper Corp	Morgan Stanley	1.027	0,00
(743)	Kennametal Inc	Morgan Stanley	101	0,00
10.565	Kenvue Inc	Goldman Sachs International	341	0,00
(328.021)	Kenvue Inc	Morgan Stanley	2.409	0,00
127.098	Kering SA	Goldman Sachs International	5.426	0,00
(1.582.107)	Keurig Dr Pepper Inc	Morgan Stanley	157.840	0,01
(208.907)	Keurig Dr Pepper Inc	Goldman Sachs International	107	0,00
(411.576)	Keurig Dr Pepper Inc	JPMorgan Chase Bank	29.140	0,00
813	Keysight Technologies Inc	Morgan Stanley	604	0,00
(75.863)	Kilroy Realty Corp	Morgan Stanley	23.889	0,00
471.513	Kimberly-Clark Corp	JPMorgan Chase Bank	1.404	0,00
281.046	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs International	1.343	0,00
747.359	Kimberly-Clark Corp	Morgan Stanley	42.928	0,00
18.457	Kinder Morgan Inc	Morgan Stanley	564	0,00
(185)	Kinetik Holdings Inc	Morgan Stanley	74	0,00
(51)	Kinross Gold Corp	Morgan Stanley	1	0,00
47.479	Kinsale Capital Group Inc	Morgan Stanley	6.742	0,00
(106.237)	KLA Corp	Morgan Stanley	39.643	0,00
26.661	Klaviyo Inc Class A	Goldman Sachs International	3.791	0,00
1.955.305	Klepierre SA	Société Générale	0	0,00
(67.219)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Goldman Sachs International	195	0,00
(7.515)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Morgan Stanley	246	0,00
(397.549)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	13.560	0,00
732.366	Koninklijke Ahold Delhaize NV	JPMorgan Chase Bank	16.251	0,00
209.317	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Goldman Sachs International	3.639	0,00
352	Kontoor Brands Inc	Morgan Stanley	809	0,00
273	Korn Ferry	Morgan Stanley	137	0,00
(5.776)	Kosmos Energy Ltd	Morgan Stanley	1.827	0,00
(711)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Morgan Stanley	121	0,00
(249.079)	Kroger Co	Goldman Sachs International	0	0,00
580.283	Kroger Co	Morgan Stanley	9.426	0,00
3.257	Kyndryl Holdings Inc	Morgan Stanley	1.984	0,00
5.700.000	Lagfin SCA	Société Générale	343.501	0,02
2.900.620	Lam Research Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(103.709)	Lam Research Corp	Morgan Stanley	35.534	0,00
(229.457)	Lamb Weston Holdings Inc	Morgan Stanley	30.977	0,00
(406.019)	Lamb Weston Holdings Inc	Goldman Sachs International	20.413	0,00
(987.337)	Lamb Weston Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	122.009	0,02

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(364.130)	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
4.486	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	3.728	0,00
(84.460)	Lazard Ltd Class A	Morgan Stanley	13.256	0,00
(125.318)	Lear Corp	Morgan Stanley	8.393	0,00
(76.505)	Legal & General Group Plc	Goldman Sachs International	3.088	0,00
8.501	Legalzoom.com Inc	Morgan Stanley	435	0,00
30.472	Legend Biotech Corp	Goldman Sachs International	236	0,00
68.275	Legend Biotech Corp	JPMorgan Chase Bank	1.413	0,00
399	Leidos Holdings Inc	Morgan Stanley	98	0,00
(2.884)	Lemonade Inc	Morgan Stanley	3.730	0,00
2.205	Lennar Corp Class A	Morgan Stanley	1.894	0,00
320	Lennox International Inc	Morgan Stanley	2.340	0,00
59.251	Liberty Broadband Corp Class C	Morgan Stanley	1.468	0,00
(10.488)	Liberty Energy Inc	Morgan Stanley	6.303	0,00
2.005	Liberty Latin America Ltd Class C	Morgan Stanley	361	0,00
(279)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	Morgan Stanley	149	0,00
9.494	Life Time Group Holdings Inc	Morgan Stanley	678	0,00
654	Lightspeed Commerce Inc	Morgan Stanley	715	0,00
(79.939)	Lincoln National Corp	Morgan Stanley	11.449	0,00
2.434	Lindblad Expeditions Holdings Inc	Morgan Stanley	1.512	0,00
4	Lions Gate Entertainment Corp Class B	Morgan Stanley	1	0,00
(976.406)	Lithia Motors Inc Class A	Morgan Stanley	57.348	0,01
28	Lithium Americas Argentina Corp	Morgan Stanley	3	0,00
20.824.073	Live Nation Entertainment Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(127.535)	Live Nation Entertainment Inc	Morgan Stanley	14.513	0,00
38.500.000	Live Nation Entertainment Inc	Société Générale	3.685.886	0,23
716	LivePerson Inc	Morgan Stanley	310	0,00
1.000.000	Lloyds Banking Group Plc	Société Générale	75.007	0,00
2.997	Lockheed Martin Corp	Morgan Stanley	21.607	0,00
1.737	Loews Corp	Morgan Stanley	2.149	0,00
802.905	Louisiana-Pacific Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
416.071	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.310	LPL Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	5.492	0,00
(752.063)	LPP SA	Goldman Sachs International	31.062	0,00
(1.135.139)	LPP SA	JPMorgan Chase Bank	36.567	0,00
28.547	Lucid Group Inc	Morgan Stanley	6.880	0,00
1.445.141	Lululemon Athletica Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(104.698)	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	22.156	0,00
6.532.910	Lyft Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
191.171	LyondellBasell Industries NV Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.179)	M&T Bank Corp	Morgan Stanley	345	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(4.057)	Macerich Co	Morgan Stanley	392	0,00
(6.410)	Madison Square Garden Entertainment Corp	Morgan Stanley	241	0,00
(2.957)	MAG Silver Corp	Morgan Stanley	701	0,00
(65)	Magnite Inc	Morgan Stanley	16	0,00
(2.190)	Magnolia Oil & Gas Corp Class A	Morgan Stanley	1.780	0,00
67.041	Magnolia Oil & Gas Corp Class A	Goldman Sachs International	4.142	0,00
363.359	Magnolia Oil & Gas Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	1.101	0,00
(110.967)	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	9.909	0,00
(80.726)	ManpowerGroup Inc	Morgan Stanley	8.259	0,00
4.293	Manulife Financial Corp	Morgan Stanley	693	0,00
50.565	Maplebear Inc	Morgan Stanley	2.344	0,00
126.539	Marathon Oil Corp	JPMorgan Chase Bank	2.309	0,00
948.564	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
279.704	Marathon Petroleum Corp	Goldman Sachs International	2.962	0,00
1.330	MarketAxess Holdings Inc	Morgan Stanley	14.562	0,00
9.971	Marqeta Inc Class A	Morgan Stanley	714	0,00
4.030.076	Marriott Vacations Worldwide Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
4.197	Marriott Vacations Worldwide Corp	Morgan Stanley	116	0,00
(525)	Marvell Technology Inc	Morgan Stanley	320	0,00
(109.405)	Masco Corp	Morgan Stanley	30.538	0,00
(498)	Masterbrand Inc	Morgan Stanley	120	0,00
(154.054)	Mastercard Inc Class A	Morgan Stanley	15.848	0,00
(290.642)	Mastercard Inc Class A	Goldman Sachs International	14.453	0,00
(442.722)	Mastercard Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	34.274	0,00
538.445	Matador Resources Co	JPMorgan Chase Bank	19.450	0,00
(1.403)	Matador Resources Co	Morgan Stanley	1.369	0,00
12.333.162	Match Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
41	Match Group Inc	Morgan Stanley	13	0,00
(834)	Mattel Inc	Morgan Stanley	26	0,00
(166)	MaxLinear Inc Class A	Morgan Stanley	70	0,00
(252.544)	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs International	618	0,00
1.112	McCormick & Co Inc	Morgan Stanley	506	0,00
122	McKesson Corp	Morgan Stanley	886	0,00
99	MDC Holdings Inc	Morgan Stanley	155	0,00
(78.368)	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	6.382	0,00
14.064	Mediobanca SpA	JPMorgan Chase Bank	104	0,00
207.961	Mediobanca SpA	Goldman Sachs International	11.717	0,00
(74.129)	Medpace Holdings Inc	Morgan Stanley	20.696	0,00
(889.148)	Medtronic Plc	Goldman Sachs International	54.616	0,01
7.000.000	Meituan	Nomura	257.778	0,02
31.700.000	Meituan	Société Générale	902.481	0,06

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(59.170.260)	Meituan Class B	Nomura	0	0,00
811.839	Mercari Inc	JPMorgan Chase Bank	201	0,00
2.945.027	Mercari Inc	Goldman Sachs International	513	0,00
3.612.874	Mercari Inc	Morgan Stanley	3.398	0,00
(944)	Mercer International Inc	Morgan Stanley	28	0,00
(940.081)	Merck & Co Inc	Goldman Sachs International	43.441	0,00
(126.268)	Merck & Co Inc	Morgan Stanley	13.625	0,00
17.280	Merck KGaA	JPMorgan Chase Bank	277	0,00
52.528	Merck KGaA	Morgan Stanley	1.118	0,00
53.584	Merck KGaA	Goldman Sachs International	1.178	0,00
(379.993)	Merus NV	Goldman Sachs International	93.694	0,01
(505.961)	Meta Platforms Inc Class A	Morgan Stanley	69.717	0,01
1.534.431	Meta Platforms Inc Class A	Goldman Sachs International	52.351	0,00
(300.887)	Meta Platforms Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	31.955	0,00
(4.168)	MetLife Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(87.683)	MetLife Inc	Morgan Stanley	22.185	0,00
441	Mettler-Toledo International Inc	Morgan Stanley	5.437	0,00
(76.579)	Mgic Investment Corp	Morgan Stanley	12.969	0,00
8.117	MGM Resorts International	Morgan Stanley	4.161	0,00
367.868	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(111.929)	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	31.871	0,00
2.554.406	Micron Technology Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(450.318)	Microsoft Corp	JPMorgan Chase Bank	24.858	0,00
525.360	Microsoft Corp	Goldman Sachs International	2.179	0,00
(781.132)	Microsoft Corp	Morgan Stanley	81.460	0,01
437	Mid-America Apartment Communities Inc	Morgan Stanley	191	0,00
(1.123.024)	Middleby Corp	Nomura	0	0,00
(202)	MillerKnoll Inc	Morgan Stanley	274	0,00
100	Minerals Technologies Inc	Morgan Stanley	307	0,00
(107)	Mirion Technologies Inc	Morgan Stanley	4	0,00
(21.917)	Mirum Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	2.867	0,00
2.014	Mister Car Wash Inc	Morgan Stanley	300	0,00
(85)	MKS Instruments Inc	Morgan Stanley	213	0,00
1.383	Modine Manufacturing Co	Morgan Stanley	2.092	0,00
23.395.082	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	Morgan Stanley	2.624	0,00
41.160.428	MOL Hungarian Oil & Gas Plc	Goldman Sachs International	1.331	0,00
(483)	Molson Coors Beverage Co Class B	Morgan Stanley	110	0,00
109.278	Molson Coors Beverage Co Class B	Goldman Sachs International	1.804	0,00
242	Monarch Casino & Resort Inc	Morgan Stanley	111	0,00
(233.752)	Moncler SpA Class A	Goldman Sachs International	1.551	0,00
(239.354)	Moncler SpA Class A	Morgan Stanley	14.940	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(1.597.312)	Mondelez International Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	67.007	0,00
(96.692)	Mondelez International Inc Class A	Morgan Stanley	667	0,00
(1.144.963)	Mondelez International Inc Class A	Goldman Sachs International	37.204	0,00
(47.956)	MongoDB Inc	Morgan Stanley	8.944	0,00
(81.085)	MongoDB Inc	JPMorgan Chase Bank	7.419	0,00
(43.291)	Monster Beverage Corp	JPMorgan Chase Bank	525	0,00
(45.761)	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	1.508	0,00
907	Montauk Renewables Inc	Morgan Stanley	75	0,00
665	Moody's Corp	Morgan Stanley	2.241	0,00
100	MoonLake Immunotherapeutics	Morgan Stanley	210	0,00
(1)	Morgan Stanley	Goldman Sachs International	1	0,00
(36.878)	Morgan Stanley	JPMorgan Chase Bank	6.848	0,00
(361.329)	Morphic Holding Inc	JPMorgan Chase Bank	119.127	0,01
(16.804)	Morphic Holding Inc	Goldman Sachs International	4.134	0,00
(115.219)	Mosaic Co	Morgan Stanley	7.447	0,00
(108.207)	Motorola Solutions Inc	Morgan Stanley	17.814	0,00
(1.314.239)	MPLX LP	JPMorgan Chase Bank	27.226	0,00
(5.324.365)	Mr Price Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	39.830	0,00
(112)	MSC Industrial Direct Co Inc Class A	Morgan Stanley	67	0,00
647	MSCI Inc	Morgan Stanley	13.161	0,00
2.294.009	Mtn Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	701	0,00
(1.234)	Mueller Industries Inc	Morgan Stanley	467	0,00
(249)	Mueller Water Products Inc Class A	Morgan Stanley	22	0,00
(248.078)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	Goldman Sachs International	358	0,00
170.321.814	Nagoya Railroad Co Ltd	Nomura	0	0,00
2.415	Napco Security Technologies Inc	Morgan Stanley	1.053	0,00
12.671	Nasdaq Inc	Morgan Stanley	31.281	0,00
1.337	Natera Inc	Morgan Stanley	5.645	0,00
381.740	National Fuel Gas Co	Goldman Sachs International	14.047	0,00
817.361	National Fuel Gas Co	JPMorgan Chase Bank	77.107	0,01
5.326	National Vision Holdings Inc	Morgan Stanley	5.105	0,00
(85.347)	Natwest Group Plc	Goldman Sachs International	6.221	0,00
(147.397)	Natwest Group Plc	Société Générale	0	0,00
(3.011)	Navient Corp	Morgan Stanley	1.312	0,00
(282)	NBT Bancorp Inc	Morgan Stanley	162	0,00
3.900.000	NCL Corp Ltd	Nomura	774.205	0,05
7.950.000	NCL Corp Ltd	Goldman Sachs International	1.049.908	0,07
254	NCR Atleos Corp	Morgan Stanley	28	0,00
5.313.913	Nedbank Group Ltd	Goldman Sachs International	10.268	0,00
480	Nelnet Inc Class A	Morgan Stanley	589	0,00
(15.088)	Neogen Corp	Morgan Stanley	1.265	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(1.290)	NeoGenomics Inc	Morgan Stanley	4.620	0,00
(30.382)	NerdWallet Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	7.842	0,00
5.172	NerdWallet Inc Class A	Morgan Stanley	3.034	0,00
(20.244)	NET Lease Office Properties	Morgan Stanley	2.130	0,00
(106.462)	NetApp Inc	Morgan Stanley	18.264	0,00
705.212	NetApp Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
728.820	Netflix Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(127.372)	Netflix Inc	Morgan Stanley	28.595	0,00
813.981	Neurocrine Biosciences Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(41.557)	Neurocrine Biosciences Inc	Morgan Stanley	7.609	0,00
254	Nevro Corp	Morgan Stanley	72	0,00
(17.023)	New Ambrx Biopharma Inc	Morgan Stanley	2.692	0,00
(167.541)	New Ambrx Biopharma Inc	JPMorgan Chase Bank	84.350	0,01
(16.936)	New Ambrx Biopharma Inc	Goldman Sachs International	8.220	0,00
2.533	New Jersey Resources Corp	Morgan Stanley	705	0,00
(23.335)	New York Community Bancorp Inc	Morgan Stanley	1.363	0,00
856	New York Times Co Class A	Morgan Stanley	2.402	0,00
232	Newmark Group Inc Class A	Morgan Stanley	116	0,00
(3.114)	Newmont Corp	Morgan Stanley	1.242	0,00
3.000.000	Nexi SpA	BNP Paribas	244.246	0,02
9.800.000	Nexi SpA	Société Générale	1.108.174	0,07
34.362	Nexi SpA	Goldman Sachs International	0	0,00
(83.955)	Nexstar Media Group Inc	Morgan Stanley	9.651	0,00
4.584	NextEra Energy Inc	Morgan Stanley	994	0,00
1.007	NEXTracker Inc Class A	Morgan Stanley	1.549	0,00
25.194.036	NIO Inc	Nomura	1.635.648	0,11
2.659.404.400	Nippon Steel Corp	Société Générale	0	0,00
772	NiSource Inc	Morgan Stanley	188	0,00
12.065	NNN REIT Inc	Morgan Stanley	4.099	0,00
(3.300.812)	Nordea Bank Abp	Goldman Sachs International	18.647	0,00
(355)	Nordic American Tankers Ltd	Morgan Stanley	41	0,00
(76.188)	Nordstrom Inc	Morgan Stanley	19.124	0,00
(6.416)	Northern Oil & Gas Inc	Morgan Stanley	5.980	0,00
1.646	Northfield Bancorp Inc	Morgan Stanley	277	0,00
1.265	Northwest Bancshares Inc	Morgan Stanley	15	0,00
100	Northwest Natural Holding Co	Morgan Stanley	29	0,00
(2.543)	Northwestern Energy Group Inc	Morgan Stanley	1.404	0,00
309.878	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	3.448	0,00
5.865.443	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
(10.567)	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Morgan Stanley	1.194	0,00
(613.281)	NOV Inc	Goldman Sachs International	7.343	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(28)	Novagold Resources Inc	Morgan Stanley	3	0,00
(301.171)	Novartis AG	JPMorgan Chase Bank	22.658	0,00
(167.672)	Novartis AG	Goldman Sachs International	4.583	0,00
(3.019.012)	Novo Nordisk A/S	JPMorgan Chase Bank	7.457	0,00
(737.098)	Novo Nordisk A/S	Morgan Stanley	684	0,00
(7.013.655)	Novo Nordisk A/S	Goldman Sachs International	290	0,00
3.500	Novocure Ltd	Morgan Stanley	6.483	0,00
(2.341)	NOW Inc	Morgan Stanley	290	0,00
(73.565)	NU Holdings Ltd Class A	JPMorgan Chase Bank	4.719	0,00
51.394	NU Holdings Ltd Class A	Goldman Sachs International	2.797	0,00
(46.072)	NU Holdings Ltd Class A	Morgan Stanley	7.554	0,00
191.535	Nu Skin Enterprises Inc Class A	Goldman Sachs International	18.682	0,00
134.135	Nu Skin Enterprises Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	10.481	0,00
404.914	Nucor Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.106)	Nucor Corp	Morgan Stanley	2.694	0,00
7.257	Nutanix Inc Class A	Morgan Stanley	7.611	0,00
(141.539)	Nuvalent Inc Class A	Goldman Sachs International	60.479	0,01
(90.505)	Nuvalent Inc Class A	Morgan Stanley	33.987	0,00
(25.941)	Nuvei Corp	JPMorgan Chase Bank	18.088	0,00
(310.303)	nVent Electric Plc	Goldman Sachs International	43.290	0,00
(188.198)	nVent Electric Plc	JPMorgan Chase Bank	19.183	0,00
(265.887)	NVIDIA Corp	Morgan Stanley	27.186	0,00
897.107	NVIDIA Corp	Goldman Sachs International	7.511	0,00
(5.408)	NVIDIA Corp	JPMorgan Chase Bank	28	0,00
3.064.396	Ocado Group Plc	Société Générale	309.829	0,02
69.668	Occidental Petroleum Corp	Morgan Stanley	8.195	0,00
(799)	Oceaneering International Inc	Morgan Stanley	157	0,00
10.139.541	Okta Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
50.933	Olaplex Holdings Inc	Goldman Sachs International	14.381	0,00
(36.665)	Olaplex Holdings Inc	Morgan Stanley	11.133	0,00
426.533	Old Dominion Freight Line	JPMorgan Chase Bank	5.626	0,00
5.192	Old Republic International Corp	Morgan Stanley	1.635	0,00
43.388	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	1.150	0,00
7.068	Olo Inc Class A	Morgan Stanley	651	0,00
(557)	Omega Healthcare Investors Inc	Morgan Stanley	169	0,00
(203)	Omnicell Inc	Morgan Stanley	205	0,00
(116.663)	Omnicom Group Inc	Morgan Stanley	21.229	0,00
142.741	OMV AG	Goldman Sachs International	5.385	0,00
204.950	On Holding AG Class A	JPMorgan Chase Bank	10.305	0,00
1.013.716	ON Semiconductor Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(54)	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	85	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
1.085	ON24 Inc	Morgan Stanley	292	0,00
(616)	ONE Gas Inc	Morgan Stanley	178	0,00
1.245.545	ONEOK Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(245)	OneSpaWorld Holdings Ltd	Morgan Stanley	84	0,00
(66.292)	Onto Innovation Inc	Morgan Stanley	15.246	0,00
7.161	Opendoor Technologies Inc	Morgan Stanley	2.487	0,00
(118)	OPENLANE Inc	Morgan Stanley	0	0,00
(119.686)	Oracle Corp	Morgan Stanley	3.542	0,00
414.719	O'Reilly Automotive Inc	JPMorgan Chase Bank	920	0,00
100	Organon & Co	Morgan Stanley	4	0,00
387.665	Ormat Technologies Inc	Goldman Sachs International	7.208	0,00
10.383.362	Ormat Technologies Inc	Nomura	435.549	0,03
(749.595)	Orsted AS	Goldman Sachs International	7.632	0,00
41.334	Oscar Health Inc Class A	Morgan Stanley	38.416	0,00
69.724.500	OSG Corp	Nomura	0	0,00
(81.190)	Oshkosh Corp	Morgan Stanley	13.854	0,00
(224)	Osisko Gold Royalties Ltd	Morgan Stanley	101	0,00
(115.731.058)	OTP Bank Nyrt	JPMorgan Chase Bank	49.030	0,01
(145.764.721)	OTP Bank Nyrt	Goldman Sachs International	79.076	0,01
(206)	Outset Medical Inc	Morgan Stanley	105	0,00
75.777	Ovintiv Inc	Morgan Stanley	3.812	0,00
(57.762)	Ovintiv Inc	Goldman Sachs International	823	0,00
(122.599)	Owens Corning	Morgan Stanley	17.563	0,00
(668.261)	PACCAR Inc	Goldman Sachs International	29.649	0,00
(268.824)	PACCAR Inc	JPMorgan Chase Bank	8.175	0,00
1.520	PACCAR Inc	Morgan Stanley	118	0,00
(2.048)	Pacific Biosciences of California Inc	Morgan Stanley	436	0,00
19.257	Pacira BioSciences Inc	JPMorgan Chase Bank	2.199	0,00
199.432	Pacira BioSciences Inc	Goldman Sachs International	3.615	0,00
37.804	Pacira BioSciences Inc	Morgan Stanley	481	0,00
100	Pactiv Evergreen Inc	Morgan Stanley	81	0,00
(179.669)	Pagseguro Digital Ltd Class A	Goldman Sachs International	54.170	0,01
(4.523)	Palantir Technologies Inc Class A	Morgan Stanley	1.600	0,00
(61.655)	Palo Alto Networks Inc	Morgan Stanley	17.104	0,00
130.174.440	Palo Alto Networks Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
38.900.000	Palo Alto Networks Inc	Société Générale	23.584.410	1,45
(2.340.145)	Pandora A/S	Goldman Sachs International	40.150	0,00
(3.084.025)	Pandora A/S	JPMorgan Chase Bank	120.272	0,01
1.571	Paragon 28 Inc	Morgan Stanley	228	0,00
(102.110)	Paramount Global Class B	Morgan Stanley	43.024	0,00
(582)	Paramount Group Inc	Morgan Stanley	117	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(360)	Park Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	523	0,00
(1.294.964)	Parker-Hannifin Corp	Goldman Sachs International	163.664	0,01
(827.923)	Parker-Hannifin Corp	Morgan Stanley	56.079	0,01
(672.132)	Parker-Hannifin Corp	JPMorgan Chase Bank	103.842	0,01
2.177	Parsons Corp	Morgan Stanley	36	0,00
31.631	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs International	2.177	0,00
1.610	Patterson Cos Inc	Morgan Stanley	879	0,00
203.929	Paychex Inc	Goldman Sachs International	4.677	0,00
1.596	Paycom Software Inc	Morgan Stanley	1.937	0,00
91.221	Paycor HCM Inc	JPMorgan Chase Bank	707	0,00
42.368	Paycor HCM Inc	Morgan Stanley	1.908	0,00
(76.896)	Paylocity Holding Corp	Morgan Stanley	4.865	0,00
7.768	Paylocity Holding Corp	Goldman Sachs International	67	0,00
104.100	Paylocity Holding Corp	JPMorgan Chase Bank	220	0,00
(61.489)	PayPal Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	3.754	0,00
(2.156)	PBF Energy Inc Class A	Morgan Stanley	3.924	0,00
905	PDF Solutions Inc	Morgan Stanley	583	0,00
22.907.376	Peabody Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
373	Pediatrix Medical Group Inc	Morgan Stanley	91	0,00
(66.415)	Pegasystems Inc	Morgan Stanley	11.549	0,00
1.410	Penn Entertainment Inc	Morgan Stanley	1.025	0,00
63	PennyMac Financial Services Inc	Morgan Stanley	52	0,00
(3.583)	PennyMac Mortgage Investment Trust	Morgan Stanley	1.989	0,00
(2.526)	Penske Automotive Group Inc	Morgan Stanley	954	0,00
1.606	Pentair Plc	Morgan Stanley	1.457	0,00
(248)	Peoples Bancorp Inc	Morgan Stanley	68	0,00
(341.500)	Pepkor Holdings Ltd	Morgan Stanley	2.763	0,00
(6.630.040)	Pepkor Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	48.731	0,01
(56.611)	PepsiCo Inc	JPMorgan Chase Bank	3.665	0,00
1.021.511	PepsiCo Inc	Morgan Stanley	23.186	0,00
(80.710)	Perrigo Co Plc	Morgan Stanley	8.579	0,00
(28.929)	Petco Health & Wellness Co Inc	Morgan Stanley	7.498	0,00
1.037.246	PG&E Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(381.758)	Phillips 66	Goldman Sachs International	64.215	0,01
(89.865)	Phillips 66	Morgan Stanley	3.705	0,00
(782.682)	Phillips 66	JPMorgan Chase Bank	97.238	0,01
(4.460)	Phillips Edison & Co Inc	Morgan Stanley	2.201	0,00
3.651	Phreesia Inc	Morgan Stanley	2.535	0,00
974	Pinnacle West Capital Corp	Morgan Stanley	421	0,00
(1.187)	Pinterest Inc Class A	Morgan Stanley	385	0,00
62.015	Pioneer Natural Resources Co	Goldman Sachs International	0	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
616	Piper Sandler Cos	Morgan Stanley	31	0,00
3.055	Planet Fitness Inc Class A	Morgan Stanley	3.183	0,00
(760)	Plexus Corp	Morgan Stanley	2.174	0,00
1.784	PNC Financial Services Group Inc	Morgan Stanley	3.746	0,00
1.023.939	Polaris Inc	Morgan Stanley	122.550	0,01
10.837.273	POSCO Holdings Inc	Goldman Sachs International	93.013	0,01
4.800.000	Poseidon Finance 1 Ltd	Nomura	118.818	0,01
(466.797)	Post Holdings Inc	Goldman Sachs International	32.579	0,00
(583.614)	Post Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	37.994	0,00
4.708.248	Postal Savings Bank of China Co Ltd	Nomura	0	0,00
(3.256)	PotlatchDeltic Corp	Morgan Stanley	983	0,00
(500)	Power Integrations Inc	Morgan Stanley	336	0,00
(1.352.024)	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	Goldman Sachs International	55.647	0,01
(275.434)	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	Morgan Stanley	3.103	0,00
(1.918.192)	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	JPMorgan Chase Bank	85.893	0,01
(1.098.474)	Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	JPMorgan Chase Bank	43.484	0,00
4.097	PPG Industries Inc	Morgan Stanley	7.812	0,00
3.068	PPL Corp	Morgan Stanley	222	0,00
262	PRA Group Inc	Morgan Stanley	202	0,00
(85.567)	Premier Inc Class A	Morgan Stanley	7.968	0,00
8.479	Primerica Inc	Morgan Stanley	83	0,00
(3.338)	Primo Water Corp	Morgan Stanley	576	0,00
(115.120)	Principal Financial Group Inc	Morgan Stanley	18.472	0,00
(1.758)	ProAssurance Corp	Morgan Stanley	150	0,00
2.555	Procore Technologies Inc	Morgan Stanley	3.911	0,00
(170.340)	Procter & Gamble Co	JPMorgan Chase Bank	2.853	0,00
74.482	Procter & Gamble Co	Morgan Stanley	2.294	0,00
2.359	Progressive Corp	Morgan Stanley	5.852	0,00
(270)	Progyny Inc	Morgan Stanley	83	0,00
(104.660)	Prosus NV	Morgan Stanley	3.022	0,00
114.806	Prosus NV	JPMorgan Chase Bank	8.157	0,00
(318.639)	Prosus NV	Goldman Sachs International	21.487	0,00
(122.305)	Prudential Financial Inc	Morgan Stanley	14.094	0,00
242.293	Prudential Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.920.768)	Prudential Plc	Morgan Stanley	0	0,00
(275.925)	PTC Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	47.044	0,01
(366.516)	PTC Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	59.321	0,01
4.370	PTC Therapeutics Inc	Morgan Stanley	541	0,00
(40)	Public Storage	Morgan Stanley	44	0,00
(213.070)	PulteGroup Inc	Morgan Stanley	1.352	0,00
(744.271)	PulteGroup Inc	JPMorgan Chase Bank	2.549	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(135)	Pure Storage Inc Class A	Morgan Stanley	30	0,00
(296.583)	PVH Corp	Goldman Sachs International	79.979	0,01
(1.503.443)	PVH Corp	JPMorgan Chase Bank	526.528	0,03
1.221.125	Qorvo Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(201.515)	Qorvo Inc	Morgan Stanley	31.638	0,00
(126.840)	QUALCOMM Inc	Morgan Stanley	16.502	0,00
(192.293)	Quanta Services Inc	Goldman Sachs International	48.713	0,01
(1.785)	QuantumScape Corp	Morgan Stanley	578	0,00
(929.528)	Quest Diagnostics Inc	Goldman Sachs International	45.990	0,01
(84.706)	QuidelOrtho Corp	Morgan Stanley	4.207	0,00
50.669	R1 RCM Inc	Morgan Stanley	12.695	0,00
(2.892)	Radian Group Inc	Morgan Stanley	10	0,00
1.616.871	Ralph Lauren Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.169	Rambus Inc	Morgan Stanley	1.857	0,00
44.252	Range Resources Corp	Morgan Stanley	5.186	0,00
277.307	Range Resources Corp	Goldman Sachs International	30.747	0,00
316.168	Range Resources Corp	JPMorgan Chase Bank	35.575	0,00
(55)	Raymond James Financial Inc	Morgan Stanley	87	0,00
2.882	RE/MAX Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	1.580	0,00
(6.450)	Ready Capital Corp	Morgan Stanley	4.070	0,00
5.578	Redfin Corp	Morgan Stanley	4.022	0,00
(533.427)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	9.615	0,00
(334.633)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	16.283	0,00
(42.044)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	3.575	0,00
(76.259)	Reinsurance Group of America Class A	Morgan Stanley	9.598	0,00
(2.462)	Remitly Global Inc	Morgan Stanley	3.860	0,00
(25.405)	Remitly Global Inc	JPMorgan Chase Bank	678	0,00
(1.534)	Repligen Corp	Morgan Stanley	3.291	0,00
813	REV Group Inc	Morgan Stanley	130	0,00
17.079	Revance Therapeutics Inc	Morgan Stanley	12.568	0,00
16.302	Revance Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	10.786	0,00
(100.123)	REVOLUTION Medicines Inc	Goldman Sachs International	40.380	0,00
(189.842)	REVOLUTION Medicines Inc	JPMorgan Chase Bank	91.663	0,01
(703)	Revolve Group Inc	Morgan Stanley	1.074	0,00
2.654	Rexford Industrial Realty Inc	Morgan Stanley	602	0,00
338.935	Reynolds Consumer Products Inc	JPMorgan Chase Bank	20.095	0,00
566	Reynolds Consumer Products Inc	Morgan Stanley	130	0,00
(72.617)	RH	Morgan Stanley	18.303	0,00
934.474	RH	Goldman Sachs International	0	0,00
41.902.746	Rheinmetall AG	Société Générale	4.940.082	0,31
44.713	Rhythm Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	1.317	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
2.889	RingCentral Inc Class A	Morgan Stanley	911	0,00
(408.309)	Rio Tinto Plc	Goldman Sachs International	61.982	0,01
(9.326)	Rio Tinto Plc	Morgan Stanley	77	0,00
(32.111)	Rio Tinto Plc	JPMorgan Chase Bank	432	0,00
(17.388)	Riot Platforms Inc	Morgan Stanley	25.880	0,00
(68.964)	Rithm Capital Corp	Morgan Stanley	11.738	0,00
4.636.216	Rivian Automotive Inc Class A	Nomura	0	0,00
(8.480)	Rivian Automotive Inc Class A	Morgan Stanley	2.434	0,00
5.000.000	Rivian Automotive Inc	Nomura	1.491.895	0,09
(404)	RLJ Lodging Trust	Morgan Stanley	94	0,00
(113.041)	Robert Half International Inc	Morgan Stanley	25.249	0,00
1.371.041	Roche Holding AG	Goldman Sachs International	113.282	0,02
(855)	Rocket Cos Inc Class A	Morgan Stanley	257	0,00
(122.810)	Rockwell Automation Inc	Goldman Sachs International	15.837	0,00
(169.286)	Rockwell Automation Inc	JPMorgan Chase Bank	24.139	0,00
(21.874)	Rogers Communications Inc	JPMorgan Chase Bank	259	0,00
(52.119)	Rogers Communications Inc	Morgan Stanley	2.083	0,00
(157.413)	Rogers Communications Inc	Goldman Sachs International	22.898	0,00
(211)	Rogers Corp	Morgan Stanley	544	0,00
2.508	Roku Inc	Morgan Stanley	2.203	0,00
(121.298)	Rollins Inc	Morgan Stanley	15.070	0,00
(72)	Roper Technologies Inc	Morgan Stanley	10	0,00
(1.077.960)	Ross Stores Inc	JPMorgan Chase Bank	27.343	0,00
2.209	Royal Bank of Canada	Morgan Stanley	1.742	0,00
(1.031.187)	Royal Caribbean Cruises Ltd	JPMorgan Chase Bank	312.690	0,02
1.338	Royal Caribbean Cruises Ltd	Morgan Stanley	8.633	0,00
163.556	Royalty Pharma Plc Class A	Goldman Sachs International	23.852	0,00
2.062	Royalty Pharma Plc Class A	Morgan Stanley	1.500	0,00
75.853	RPC Inc	Goldman Sachs International	4.612	0,00
(6.217)	RPC Inc	Morgan Stanley	798	0,00
273.717	RPC Inc	JPMorgan Chase Bank	49.282	0,01
3.394	RTX Corp	Morgan Stanley	5.252	0,00
(258.758)	RWE AA	Goldman Sachs International	28.452	0,00
(474)	RXO Inc	Morgan Stanley	275	0,00
1.156	RxSight Inc	Morgan Stanley	2.135	0,00
1.140	Ryan Specialty Holdings Inc	Morgan Stanley	98	0,00
(703.288)	Ryanair Holdings Plc	JPMorgan Chase Bank	98.367	0,01
(82.319)	Ryder System Inc	Morgan Stanley	8.473	0,00
(668.180)	SABESP ON	Goldman Sachs International	32.282	0,00
(443)	Sabra Health Care REIT Inc	Morgan Stanley	86	0,00
34.641	Sabre Corp	Morgan Stanley	3.338	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
318.856	Saipem SpA	Société Générale	0	0,00
2.500.000	Saipem SpA	Nomura	105.741	0,01
(135.082)	Salesforce Inc	Morgan Stanley	7.597	0,00
20.818	Samsara Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	678	0,00
25.064	Samsara Inc Class A	Goldman Sachs International	487	0,00
468	Sandy Spring Bancorp Inc	Morgan Stanley	292	0,00
(4.123.245)	Sanlam Ltd	Morgan Stanley	16.526	0,00
(2.769.104)	Sanlam Ltd	JPMorgan Chase Bank	19.121	0,00
(2.188.619)	Sanlam Ltd	Goldman Sachs International	1.091	0,00
(3.516)	Sanmina Corp	Morgan Stanley	4.079	0,00
(1.090.396)	Santander Bank Polska SA	Goldman Sachs International	30.484	0,00
54.155	Sarepta Therapeutics Inc	Morgan Stanley	6.440	0,00
15.161.441	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(472.590)	Sartorius AG-Vorzug	JPMorgan Chase Bank	108.032	0,01
(10.961)	Sartorius AG-Vorzug	Goldman Sachs International	735	0,00
5.623.144	Sasol Ltd	JPMorgan Chase Bank	60.610	0,01
3.419.296	Sasol Ltd	Goldman Sachs International	13.317	0,00
(8.449)	SBA Communications Corp	JPMorgan Chase Bank	143	0,00
(24.309)	SBA Communications Corp	Goldman Sachs International	4.498	0,00
(65.055)	SBA Communications Corp	Morgan Stanley	3.956	0,00
750.000.000	SBI Holdings Inc	Nomura	348.854	0,02
3.490.963.413	SBI Holdings Inc	Société Générale	0	0,00
(13.498)	Schlumberger NV	Morgan Stanley	13.366	0,00
47.507	Schneider National Inc Class B	Morgan Stanley	2.226	0,00
(84.510)	Science Applications International Corp	Morgan Stanley	6.220	0,00
(54)	Scientific Games Corp Class A	Morgan Stanley	5	0,00
(408)	Scorpio Tankers Inc	Morgan Stanley	638	0,00
27.750.000	Seagate HDD Cayman	Nomura	5.198.688	0,32
19.257.199	Seagate Technology Holdings Plc	Nomura	0	0,00
(116.752)	Sealed Air Corp	Morgan Stanley	17.871	0,00
(101)	SEI Investments Co	Morgan Stanley	4	0,00
(1.317)	Select Medical Holdings Corp	Morgan Stanley	1.067	0,00
14.157	Sempra	Morgan Stanley	13.531	0,00
(27.915)	Semtech Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(133.717)	Sensata Technologies Holding	Morgan Stanley	10.698	0,00
(456)	Sensient Technologies Corp	Morgan Stanley	72	0,00
1.678	SentinelOne Inc Class A	Morgan Stanley	832	0,00
1.765	Service Corp International	Morgan Stanley	207	0,00
(223.631)	ServiceNow Inc	Morgan Stanley	46.571	0,00
2.917.465	ServiceNow Inc	Goldman Sachs International	17.196	0,00
(65.144)	ServiceNow Inc	JPMorgan Chase Bank	12.460	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
160.812	Severn Trent Plc	Goldman Sachs International	1.169	0,00
(1.924)	SFL Corp Ltd	Morgan Stanley	332	0,00
866	Shake Shack Inc Class A	Morgan Stanley	90	0,00
(330.857)	Sharkninja Inc	JPMorgan Chase Bank	59.416	0,01
(565.715)	Sharkninja Inc	Morgan Stanley	88.401	0,01
(93.161)	Sharkninja Inc	Goldman Sachs International	9.487	0,00
1.587.455	Sherwin-Williams Co	Goldman Sachs International	0	0,00
(116.626)	Sherwin-Williams Co	Morgan Stanley	28.564	0,00
(4.145.837)	Shift4 Payments Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(231.858)	Shockwave Medical Inc	Goldman Sachs International	16.845	0,00
(10.704)	Shopify Inc Class A	Goldman Sachs International	4.214	0,00
(117.879)	Shopify Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	12.928	0,00
(19.876)	Shopify Inc Class A	Morgan Stanley	1.009	0,00
178	SI-BONE Inc	Morgan Stanley	36	0,00
49.705.436	Siemens Energy AG	Société Générale	0	0,00
77.200.000	Siemens Energy Finance BV	Société Générale	1.226.294	0,08
(188)	SIGA Technologies Inc	Morgan Stanley	15	0,00
(416.591)	Signet Jewelers Ltd	JPMorgan Chase Bank	182.078	0,01
(1.149.647)	Signet Jewelers Ltd	Morgan Stanley	471.456	0,03
672.097	Signet Jewelers Ltd	Goldman Sachs International	2.234	0,00
1.279	Silk Road Medical Inc	Morgan Stanley	2.727	0,00
(1.527)	SilverCrest Metals Inc	Morgan Stanley	81	0,00
(1.617)	Simmons First National Corp Class A	Morgan Stanley	217	0,00
5.800.000	Simon Global Development BV	Société Générale	535.304	0,04
917.261	Simon Property Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(108.346)	Simon Property Group Inc	Morgan Stanley	39.668	0,00
(54.667)	Simply Good Foods Co	JPMorgan Chase Bank	338	0,00
(47.883)	Simply Good Foods Co	Morgan Stanley	676	0,00
43.890	Sirius XM Holdings Inc	Morgan Stanley	7.391	0,00
25.145.300	SK Hynix Inc	Goldman Sachs International	167.377	0,01
13.800.000	SK Hynix Inc	Bank of America Merrill Lynch	1.141.050	0,07
(83.985)	Skechers USA Inc Class A	Morgan Stanley	5.264	0,00
(1.085.160)	Skechers USA Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	219.541	0,02
901.030	Skechers USA Inc Class A	Goldman Sachs International	50.674	0,01
(78)	Skechers USA Inc	Morgan Stanley	14	0,00
182	SkyWest Inc	Morgan Stanley	231	0,00
(180.389)	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(1.412)	SL Green Realty Corp	Morgan Stanley	1.988	0,00
(72.238)	SLM Corp	Morgan Stanley	33.508	0,00
(171.039)	SM Energy Co	JPMorgan Chase Bank	10.733	0,00
(86.439)	SM Energy Co	Goldman Sachs International	3.561	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(989)	SM Energy Co	Morgan Stanley	428	0,00
5.236	SMART Global Holdings Inc	Morgan Stanley	2.912	0,00
(72.725)	Smartsheet Inc Class A	Morgan Stanley	18.849	0,00
4.600.000	Snam SpA	Société Générale	403.206	0,03
(351.483)	Societe Generale SA	Goldman Sachs International	40.918	0,00
(1.236)	SolarEdge Technologies Inc	Morgan Stanley	5.368	0,00
1.639	SolarWinds Corp	Morgan Stanley	1.370	0,00
(769)	Sonos Inc	Morgan Stanley	45	0,00
(2.611)	South State Corp	Morgan Stanley	2.226	0,00
(13)	Southern Copper Corp	Morgan Stanley	23	0,00
(17.347)	Southwest Airlines Co	Morgan Stanley	7.877	0,00
(67.047)	Southwestern Energy Co	Morgan Stanley	5.297	0,00
226.168	Sovos Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	1.715	0,00
287.609	Sovos Brands Inc	Goldman Sachs International	4.356	0,00
(171.023)	Spectrum Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	26.288	0,00
(67.774)	Spectrum Brands Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	5.797	0,00
(1.508.971)	Spectrum Brands Holdings Inc	Goldman Sachs International	223.339	0,02
(25.337)	Sphere Entertainment Co	JPMorgan Chase Bank	4.492	0,00
(33.552)	Sphere Entertainment Co	Goldman Sachs International	2.836	0,00
(5.796)	Sphere Entertainment Co	Morgan Stanley	4.326	0,00
1.193	Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	393	0,00
953	Spotify Technology SA	JPMorgan Chase Bank	19	0,00
24.995	SpringBig Holdings Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
5.057	Sprinklr Inc Class A	Morgan Stanley	1.232	0,00
(405)	Sprouts Farmers Market Inc	Morgan Stanley	29	0,00
220	SPX Technologies Inc	Morgan Stanley	294	0,00
3.874	Squarespace Inc Class A	Morgan Stanley	12.884	0,00
(515)	SS&C Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	64	0,00
(338.762)	SSE Plc	Goldman Sachs International	48.539	0,01
(20)	Stagwell Inc	Morgan Stanley	1	0,00
(4.474.949)	Standard Bank Group Ltd	Goldman Sachs International	29.833	0,00
(8.163.711)	Standard Bank Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	63.031	0,01
232.414	Starbucks Corp	Goldman Sachs International	3.820	0,00
1.035	Starbucks Corp	Morgan Stanley	795	0,00
403.867	Starbucks Corp	JPMorgan Chase Bank	11.475	0,00
78.679	Stem Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(116)	Stericycle Inc	Morgan Stanley	46	0,00
(3.359)	Steven Madden Ltd	Morgan Stanley	4.064	0,00
(621)	Stifel Financial Corp	Morgan Stanley	320	0,00
3.200.000	Stillwater Mining Co	Bank of America Merrill Lynch	648.000	0,04
59.374	STMicroelectronics NV	Morgan Stanley	1.400	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
50.648	Stoneco Ltd Class A	Goldman Sachs International	1.346	0,00
465	Stoneridge Inc	Morgan Stanley	152	0,00
323	Stryker Corp	Morgan Stanley	2.330	0,00
(2.006)	Suncor Energy Inc	Morgan Stanley	790	0,00
1.305.115	Sunnova Energy International Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(544)	Sunstone Hotel Investors Inc	Morgan Stanley	32	0,00
(306)	Super Micro Computer Inc	Morgan Stanley	7.075	0,00
100	Supernus Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	115	0,00
(349.445)	Surgery Partners Inc	Goldman Sachs International	28.354	0,00
(1.578)	Surgery Partners Inc	Morgan Stanley	1.004	0,00
(2.182.103)	Svenska Handelsbanken	Goldman Sachs International	25.958	0,00
(654.259)	Swedish Orphan Biovitrum AB	Morgan Stanley	670	0,00
(5.549.808)	Swedish Orphan Biovitrum AB	JPMorgan Chase Bank	74.160	0,00
(2.543.468)	Swedish Orphan Biovitrum AB	Goldman Sachs International	22.673	0,00
3.052.619	Swiss Prime Site AG	Société Générale	0	0,00
12.803.586	Swiss Re AG	Goldman Sachs International	8.107	0,00
8.848.804	Swiss Re AG	Société Générale	38.622	0,00
(443)	Sylvamo Corp	Morgan Stanley	546	0,00
(117.058)	Synchrony Financial	Morgan Stanley	33.761	0,00
74.446	Synopsys Inc	Morgan Stanley	5.069	0,00
(70.848)	Synovus Financial Corp	Morgan Stanley	30.673	0,00
(115.098)	Sysco Corp	Morgan Stanley	14.231	0,00
17.026	Sysco Corp	Goldman Sachs International	76	0,00
(237.705)	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
2.943	Tactile Systems Technology Inc	Morgan Stanley	1.177	0,00
(112.858)	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	8.682	0,00
646.086.540	Taiyo Yuden Co Ltd	Nomura	0	0,00
(121.341)	Take-Two Interactive Software Inc	Morgan Stanley	15.896	0,00
2.165.243	Take-Two Interactive Software Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(630)	Talos Energy Inc	Morgan Stanley	101	0,00
(270.115)	Tandem Diabetes Care Inc	Goldman Sachs International	62.814	0,01
1.292.286	Tanger Factory Outlet Centers Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(2.945)	Tango Therapeutics Inc	Morgan Stanley	113	0,00
(664.263)	Tapestry Inc	Morgan Stanley	164.739	0,01
(460.946)	Targa Resources Corp	JPMorgan Chase Bank	18.208	0,00
1.063.592	Targa Resources Corp	Goldman Sachs International	126.493	0,01
(967.693)	Target Corp	Morgan Stanley	305.044	0,02
(845.163)	Target Corp	JPMorgan Chase Bank	27.398	0,00
(97)	Tarsus Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	2	0,00
100	TaskUS Inc Class A	Morgan Stanley	79	0,00
(1.534)	TC Energy Corp	Morgan Stanley	1.106	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
384.755	TD SYNNEX Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(78.014)	TD SYNNEX Corp	Morgan Stanley	14.524	0,00
2.262	TE Connectivity Ltd	Morgan Stanley	564	0,00
573	TechTarget Inc	Morgan Stanley	254	0,00
(414)	Teekay Tankers Ltd Class A	Morgan Stanley	966	0,00
(410.643)	Teleflex Inc	Goldman Sachs International	41.585	0,00
(145.473)	Temple & Webster Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	30.265	0,00
(1.630.935)	Tempur Sealy International Inc	JPMorgan Chase Bank	312.698	0,02
1.912	Tempur Sealy International Inc	Morgan Stanley	2.331	0,00
330	Tenable Holdings Inc	Morgan Stanley	155	0,00
1.293.865	Tencent Holdings Ltd	Goldman Sachs International	23.306	0,00
689.715	Tenet Healthcare Corp	Goldman Sachs International	24.998	0,00
(63)	Tenet Healthcare Corp	Morgan Stanley	65	0,00
(409)	Terex Corp	Morgan Stanley	360	0,00
197.242	Tesla Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.076.056	Tetra Tech Inc	Nomura	0	0,00
70.665	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
4.472	Texas Roadhouse Inc	Morgan Stanley	13.381	0,00
(4.262)	TFS Financial Corp	Morgan Stanley	996	0,00
572.180	Thor Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(35)	Tidewater Inc	Morgan Stanley	121	0,00
(37)	TimkenSteel Corp	Morgan Stanley	5	0,00
(64.724)	TKO Group Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	2.963	0,00
(5.997)	TKO Group Holdings Inc	Morgan Stanley	127	0,00
(58.731)	TKO Group Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	335	0,00
(423.572)	T-Mobile US Inc	Morgan Stanley	72.263	0,01
(5.547.871)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(19.508)	Toast Inc Class A	Goldman Sachs International	5.691	0,00
(55.487)	Toast Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	15.987	0,00
311.971.880	Tokyu Corp	Société Générale	0	0,00
(1.530.930)	Toll Brothers Inc	Goldman Sachs International	104.938	0,01
(177.251)	Toll Brothers Inc	Morgan Stanley	30.095	0,00
(514.100)	Tractor Supply Co	Goldman Sachs International	0	0,00
206.495.168	Transcosmos Inc	Nomura	0	0,00
435	TransDigm Group Inc	Morgan Stanley	10.176	0,00
13.543	Transocean Ltd	Morgan Stanley	212	0,00
(3.893)	TransUnion	Morgan Stanley	3.409	0,00
(93.806)	TransUnion	JPMorgan Chase Bank	1.868	0,00
(460.795)	Travel + Leisure Co	Morgan Stanley	34.718	0,00
1.432	Travelers Cos Inc	Morgan Stanley	3.667	0,00
37	Travere Therapeutics Inc	Morgan Stanley	15	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(67.695)	TreeHouse Foods Inc	JPMorgan Chase Bank	4.508	0,00
1.337	Trex Co Inc	Morgan Stanley	182	0,00
(3.399)	Tri Pointe Homes Inc	Morgan Stanley	359	0,00
829	Tricon Residential Inc	Morgan Stanley	11	0,00
(472)	Trimble Inc	Morgan Stanley	36	0,00
5.447	TriNet Group Inc	Goldman Sachs International	140	0,00
(157)	TriNet Group Inc	Morgan Stanley	317	0,00
306	Tritium DCFC Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00
1.490	Trustmark Corp	Morgan Stanley	208	0,00
(4.601.448)	Truworths International Ltd	JPMorgan Chase Bank	29.979	0,00
1.200.000	TUI AG	UBS AG	324.184	0,02
(4.118)	Twilio Inc Class A	Morgan Stanley	558	0,00
533	Twist Bioscience Corp	Morgan Stanley	112	0,00
(196.769)	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs International	29.763	0,00
(200.802)	Uber Technologies Inc	Morgan Stanley	73.438	0,01
17.500.000	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs International	2.155.212	0,13
(17.500.000)	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs International	600.471	0,04
(1.728.493)	Ubisoft Entertainment SA	Société Générale	0	0,00
53.417	UCB SA	Morgan Stanley	1.697	0,00
6.800	UDR Inc	Morgan Stanley	5.445	0,00
5.878	UGI Corp	Morgan Stanley	9.247	0,00
(3.616)	UiPath Inc Class A	Morgan Stanley	1.129	0,00
(94.375)	Ulta Beauty Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
672	Ulta Beauty Inc	Morgan Stanley	5.083	0,00
(247.696)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	87.395	0,01
(227.446)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs International	59.513	0,01
10.355	UMH Properties Inc	Morgan Stanley	1.400	0,00
(1.277)	Under Armour Inc Class A	Morgan Stanley	577	0,00
(353.189)	UniCredit SpA	Goldman Sachs International	28.820	0,00
4.400.000	UniCredit SpA	Société Générale	49.414	0,01
111.983	Unilever Plc	JPMorgan Chase Bank	3.564	0,00
559.173	Unilever Plc	Goldman Sachs International	19.517	0,00
(817.173)	Union Pacific Corp	Goldman Sachs International	36.307	0,00
(1.171.099)	Union Pacific Corp	JPMorgan Chase Bank	148.137	0,02
(648.601)	Union Pacific Corp	Morgan Stanley	58.848	0,01
209.690	United Airlines Holdings Inc	Goldman Sachs International	5.732	0,00
(82.816)	United Airlines Holdings Inc	Morgan Stanley	4.065	0,00
690.257	United Parcel Service Inc Class B	JPMorgan Chase Bank	5.813	0,00
150.837	United Rentals Inc	Goldman Sachs International	290	0,00
1.560.728	United States Steel Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
107.683	United Utilities Group Plc	Goldman Sachs International	6.028	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
103	UnitedHealth Group Inc	Morgan Stanley	24	0,00
395.360	Universal Display Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
1.290	Universal Health Services Inc Class B	Morgan Stanley	3.770	0,00
11.596	Unum Group	Morgan Stanley	6.841	0,00
976	US Foods Holding Corp	Morgan Stanley	197	0,00
(78.609)	Utz Brands Inc	Goldman Sachs International	12.069	0,00
(124.813)	Utz Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	20.272	0,00
(7.840)	Utz Brands Inc	Morgan Stanley	1.685	0,00
(59.084)	UWM Holdings Corp	Morgan Stanley	35.607	0,00
(4.524)	VAALCO Energy Inc	Morgan Stanley	914	0,00
545.025	Valero Energy Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(234)	Valero Energy Corp	Morgan Stanley	242	0,00
(1.851.070)	Valvoline Inc	Morgan Stanley	140.931	0,01
(36.383)	Vaxcyte Inc	Goldman Sachs International	11.265	0,00
(8.278)	Vaxcyte Inc	Morgan Stanley	2.908	0,00
(9.131)	Vaxcyte Inc	JPMorgan Chase Bank	2.611	0,00
162	Veeva Systems Inc Class A	Morgan Stanley	916	0,00
1.463	Ventas Inc	Morgan Stanley	457	0,00
5.044	Veradigm Inc	Morgan Stanley	3.127	0,00
(73.862)	Veralto Corp	Morgan Stanley	7.886	0,00
1.874	Veralto Corp	Morgan Stanley	170	0,00
2.329	Vericel Corp	Morgan Stanley	2.066	0,00
3.714	Veris Residential Inc	Morgan Stanley	289	0,00
182.091	VeriSign Inc	JPMorgan Chase Bank	5.620	0,00
346.056	VeriSign Inc	Goldman Sachs International	2.953	0,00
(120.742)	VeriSign Inc	Morgan Stanley	3.046	0,00
(140.880)	Verisk Analytics Inc	Morgan Stanley	2.073	0,00
(215.521)	Verisk Analytics Inc	JPMorgan Chase Bank	4.262	0,00
1.626	Verizon Communications Inc	Morgan Stanley	219	0,00
133.668	Vertex Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	130	0,00
461	Vertex Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	2.026	0,00
(55.818)	Vertiv Holdings Co Class A	JPMorgan Chase Bank	148	0,00
(49.994)	Vertiv Holdings Co Class A	Morgan Stanley	469	0,00
(189.276)	Vertiv Holdings Co Class A	Goldman Sachs International	7.074	0,00
(208)	Verve Therapeutics Inc	Morgan Stanley	16	0,00
1.738	Vestis Corp	Morgan Stanley	375	0,00
(113.098)	Vici Properties Inc	Morgan Stanley	20.890	0,00
13.704.889	Virgin Galactic Holdings Inc	Nomura	942.274	0,06
(423.954)	Viridian Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	83.847	0,01
(82.823)	Virtu Financial Inc Class A	Morgan Stanley	9.144	0,00
16.470.455	Vishay Intertechnology Inc	Nomura	641.308	0,04

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(6.254)	Vishay Intertechnology Inc	Morgan Stanley	15	0,00
(3.273)	Vista Outdoor Inc	Morgan Stanley	941	0,00
(202.706)	Vistra Corp	Morgan Stanley	35.622	0,00
(1.298.164)	Vistra Corp	JPMorgan Chase Bank	411.434	0,03
(66.230)	Vital Farms Inc	Morgan Stanley	14.056	0,00
(130.168)	Vital Farms Inc	Goldman Sachs International	20.713	0,00
(12.999)	Vital Farms Inc	JPMorgan Chase Bank	119	0,00
(10.350)	Vizio Holding Corp Class A	Goldman Sachs International	2.273	0,00
3.770	Vizio Holding Corp Class A	Morgan Stanley	726	0,00
(21.689)	Vizio Holding Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	8.260	0,00
7.170.682	Vodacom Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	8.195	0,00
(30.788)	Vontier Corp	Morgan Stanley	1.059	0,00
(776)	Vornado Realty Trust	Morgan Stanley	788	0,00
(74)	Voya Financial Inc	Morgan Stanley	23	0,00
98.369	Voya Financial Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(120.420)	Vulcan Materials Co	Goldman Sachs International	9.084	0,00
(865.074)	Vulcan Materials Co	JPMorgan Chase Bank	55.917	0,01
(754)	Wabash National Corp	Morgan Stanley	105	0,00
(1.093.020)	Walgreens Boots Alliance Inc	Goldman Sachs International	23.245	0,00
(182)	Walmart Inc	Morgan Stanley	1	0,00
(665.854)	Walmart Inc	JPMorgan Chase Bank	6.644	0,00
299.985	Walmart Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(107.341)	Walt Disney Co	Morgan Stanley	7.575	0,00
23.364	Walt Disney Co	Goldman Sachs International	59	0,00
54.348	Walt Disney Co	JPMorgan Chase Bank	953	0,00
5.070	Warby Parker Inc Class A	Morgan Stanley	7.393	0,00
(76.968)	Warner Bros Discovery Inc	Morgan Stanley	51.157	0,01
(99.684)	Warner Music Group Corp Class A	Morgan Stanley	11.819	0,00
(1.477)	Warrior Met Coal Inc	Morgan Stanley	360	0,00
319	Waste Connections Inc	Morgan Stanley	252	0,00
10.968.976	Wayfair Inc Class A	Goldman Sachs International	0	0,00
(360.730)	Wayfair Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	54.215	0,01
(33.255)	Weatherford International Plc	JPMorgan Chase Bank	2.863	0,00
(94.761)	Weatherford International Plc	Goldman Sachs International	3.521	0,00
(672.127)	Weatherford International Plc	Morgan Stanley	285.146	0,02
4.830	Weave Communications Inc	Morgan Stanley	1.440	0,00
(72.146)	Webster Financial Corp	Morgan Stanley	24.040	0,00
4.200.000	Wendel SE	BNP Paribas	292.435	0,02
(86.958)	Wendy's Co	Morgan Stanley	5.633	0,00
(408)	Werner Enterprises Inc	Morgan Stanley	260	0,00
(335)	WESCO International Inc	Morgan Stanley	107	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(20.227)	West Pharmaceutical Services Inc	Morgan Stanley	138	0,00
(364.814)	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(70.827)	Western Alliance Bancorp	Morgan Stanley	35.947	0,00
537.947	Western Digital Corp	Goldman Sachs International	0	0,00
(209.220)	Western Digital Corp	Morgan Stanley	55.336	0,01
7.361	Western Union Co	Morgan Stanley	681	0,00
(1.803)	Westlake Corp	Morgan Stanley	3.382	0,00
(88.446)	WEX Inc	Morgan Stanley	5.425	0,00
83.727	Whirlpool Corp	Morgan Stanley	1.724	0,00
42.170	White Mountains Insurance Group	Morgan Stanley	58	0,00
164.828	Whitecap Resources Inc	JPMorgan Chase Bank	13.225	0,00
385.693	Whitecap Resources Inc	Goldman Sachs International	36.044	0,00
(4.233)	Whitestone REIT	Morgan Stanley	491	0,00
235	Wide Open West Inc	Morgan Stanley	36	0,00
933.584	Williams Cos Inc	Goldman Sachs International	27.785	0,00
(18.471)	Williams Cos Inc	Morgan Stanley	70	0,00
(931)	Williams-Sonoma Inc	Morgan Stanley	622	0,00
1.172	Wills Towers Watson Plc	Morgan Stanley	4.698	0,00
323.053	Wingstop Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
1.887.066	Winnebago Industries Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
(564)	Wintrust Financial Corp	Morgan Stanley	118	0,00
(15.844)	Wix.Com Ltd	Morgan Stanley	2.581	0,00
(32.876)	Wix.Com Ltd	Goldman Sachs International	14.590	0,00
(53.201)	Wix.Com Ltd	JPMorgan Chase Bank	14.763	0,00
97	Wix.com Ltd	Morgan Stanley	212	0,00
6.534	WK Kellogg Co	Morgan Stanley	3.683	0,00
100.664	Wolfspeed Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
6.625	Wolfspeed Inc	Morgan Stanley	2.077	0,00
(2.512.918)	Woolworths Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	1.609	0,00
(2.020.289)	Woolworths Holdings Ltd	Morgan Stanley	1.496	0,00
(2.159.048)	Woolworths Holdings Ltd	Goldman Sachs International	706	0,00
(5.438)	Workday Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	63	0,00
(79.836)	Workday Inc Class A	Morgan Stanley	22.054	0,00
(38.968)	Workday Inc Class A	Goldman Sachs International	9.718	0,00
(1.813)	World Kinect Corp	Morgan Stanley	505	0,00
(69.651)	Worldline SA	Goldman Sachs International	1.315	0,00
(547)	Worthington Enterprises Inc	Morgan Stanley	457	0,00
(567)	WP Carey Inc	Morgan Stanley	179	0,00
467	WW Grainger Inc	Morgan Stanley	3.105	0,00
(227.079)	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	40.555	0,00
(605.089)	Wynn Resorts Ltd	Goldman Sachs International	0	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 6,57 % (31. Dezember 2022: 2,49 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
8.998	Xcel Energy Inc	Morgan Stanley	82	0,00
(5.955)	Xerox Holdings Corp	Morgan Stanley	1.145	0,00
(179.462)	XP Inc Class A	Goldman Sachs International	18.942	0,00
(81.573)	XP Inc Class A	Morgan Stanley	9.256	0,00
(675.947)	XPO Inc	Morgan Stanley	160.745	0,01
(544.429)	XPO Inc	Goldman Sachs International	95.125	0,01
(1.168.638)	XPO Inc	JPMorgan Chase Bank	330.148	0,02
9.092	Xponential Fitness Inc Class A	Morgan Stanley	6.138	0,00
4.530	Xylem Inc	Morgan Stanley	14.524	0,00
900.711.520	Yaoko Co Ltd	Société Générale	0	0,00
(19.145)	YETI Holdings Inc	Morgan Stanley	4.011	0,00
4.655	Yext Inc	Morgan Stanley	551	0,00
(18.307)	Zai Lab Ltd	Morgan Stanley	203	0,00
(3.273)	Zealand Pharma A/S	Morgan Stanley	67	0,00
(1.742.916)	Zealand Pharma A/S	JPMorgan Chase Bank	55.499	0,01
13.324	Zeta Global Holdings Corp Class A	Morgan Stanley	11	0,00
140	Ziff Davis Inc	Morgan Stanley	39	0,00
(661.417)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Goldman Sachs International	61.576	0,01
789	Zimmer Biomet Holdings Inc	Morgan Stanley	550	0,00
169	Zoetis Inc	Morgan Stanley	52	0,00
(125.215)	Zoom Video Communications Inc Class A	Morgan Stanley	7.708	0,00
431	Zscaler Inc	Morgan Stanley	300	0,00
4.570.240	ZTO Express Cayman Inc	Goldman Sachs International	0	0,00
100	Zumiez Inc	Morgan Stanley	115	0,00
8.913	Zuora Inc Class A	Morgan Stanley	3.592	0,00
(5.637)	Zurn Elkay Water Solutions Corp	Morgan Stanley	2.726	0,00
4.475	Zynex Inc	Morgan Stanley	1.737	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Differenzkontrakten ∞			**106.923.561**	**6,57**

Gekaufte Swaptions 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Beschreibung	Gegenpartei	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Call Swaption					
525.000.000 EUR	17.01.2024	EUR Swaption, upon potential exercise of the option, the Portfolio will enter into swap with the notional value of EUR 525,000,000, in which it will pay a rate of 1.00%, and will receive iTraxx EUR S40, strike 1.05%	JPMorgan Chase Bank	40.202	0,00
Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions insgesamt ∞ **(Prämie: 713.048 US$)**				**40.202**	**0,00**

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Credit-Default-Swap-Kontrakte 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,05 %)

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
6.000.000 USD	20.12.2027	JPMorgan Chase Bank	Buying default protection on Sasol Financing USA LLC, 4.50%, 08/11/2027	617.434	0,04
17.700.000 USD	20.06.2025	Goldman Sachs International	Buying default protection on Meituan, 2.13%, 28/10/2025	65.132	0,00
1.000.000 USD	20.06.2025	Goldman Sachs International	Buying default protection on Meituan, 2.13%, 28/10/2025	3.680	0,00
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt ±				**686.246**	**0,04**

Zinsswap-Kontrakte 0,23 % (31. Dezember 2022: 2,10 %)

Nominalwert		Fällig-keit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
SEK	1.041.850.000	20.03.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,97 %	3M STIBOR	587.409	0,04
SEK	991.600.000	20.03.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,96 %	3M STIBOR	530.955	0,03
EUR	2.040.000.000	20.03.2024	Merrill Lynch International	Erhalt	3,80 %	1D €STR	508.386	0,03
HUF	1.633.000.000	20.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	7,50 %	6M BUBOR	359.396	0,02
JPY	2.698.000.000	20.09.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	0,65 %	12M JPY LIBOR	349.579	0,02
SEK	591.600.000	20.03.2026	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	2,92 %	3M STIBOR	279.861	0,02
USD	19.800.000	28.09.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	3,75 %	1D SOFR	272.504	0,02
USD	45.895.000	18.12.2029	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	3,32 %	1D SOFR	185.559	0,01
CZK	3.502.500.000	25.04.2024	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	6,30 %	1D PRIBOR	156.470	0,01
AUD	54.900.000	20.03.2029	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	4,01 %	6M BBSW	152.917	0,01
CZK	3.525.000.000	25.04.2024	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	6,32 %	1D PRIBOR	149.658	0,01
USD	30.600.000	18.12.2029	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	3,31 %	1D SOFR	112.945	0,01
CZK	3.487.500.000	25.04.2024	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	6,55 %	1D PRIBOR	59.129	0,00
ZAR	33.060.000	20.12.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	9,23 %	3M JIBAR	12.981	0,00
ZAR	121.180.000	20.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	8,07 %	3M JIBAR	6.865	0,00
PLN	100.000	15.12.2026	Intercontinental Exchange[1]	Erhalt	1,44 %	6M WIBOR	2.171	0,00
ZAR	135.490.000	20.12.2025	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	7,78 %	3M JIBAR	297	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Zinsswapkontrakten ∞							**3.727.082**	**0,23**

#Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Total Return Swap-Kontrakte 0,21 % (31. Dezember 2022: 0,12 %)

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
33.765.579 USD	28.02.2024	5,58[1]	Société Générale Basket SGBVVRRU[2]	2.229.122	0,14
96.753.102 USD	24.04.2025	0,00[3]	Goldman Sachs Basket GSVIDI1B[4]	517.673	0,03
16.542.900 EUR	05.03.2024	0,00[3]	UBS Basket UBCSFVPR[5]	264.288	0,02
1.095.104 USD	06.11.2024	5,76[6]	Morgan Stanley Basket MSNBUIHI[7]	100.877	0,01
413.740 USD	06.11.2024	5,76[6]	Morgan Stanley Basket MSNBUXBI[7]	81.733	0,01
547.794 USD	06.11.2024	5,76[6]	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM[7]	63.806	0,00
424.556 USD	21.03.2024	4,98[6]	Goldman Sachs Basket GSUCPSS2[4]	41.653	0,00
(548.751) USD	25.06.2024	4,92[8]	JPMorgan Basket JP1STP[9]	34.922	0,00

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Total Return Swap-Kontrakte 0,21 % (31. Dezember 2022: 0,12 %) (Fortsetzung)

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
(1.319.530) USD	06.11.2024	5,11[6]	Morgan Stanley Basket MSNBUXLP[7]	22.039	0,00
(1.393.969) USD	09.02.2024	4,92[8]	JPMorgan Basket JP1STP[9]	14.601	0,00
(1.718.065) USD	24.09.2024	(0,80)[3]	Morgan Stanley Basket MSCBSMMU[7]	6.023	0,00
(692.566) USD	24.09.2024	(0,80)[3]	Morgan Stanley Basket MSCBSMMU[7]	5.631	0,00
(1.267.724) USD	06.11.2024	4,03[6]	Morgan Stanley Basket MSACHDGE[7]	5.340	0,00
(743.053) USD	10.06.2024	4,92[8]	JPMorgan Basket JPAYBIO1[9]	4.415	0,00
(261.164) USD	06.11.2024	4,93[6]	Morgan Stanley Basket MSACTACT[7]	1.780	0,00
(531.544) USD	06.11.2024	5,11[6]	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY[7]	651	0,00
(627.028) USD	17.06.2033	5,40[1]	Goldman Sachs Basket GSXUEDEF[4]	484	0,00
(20.566) USD	29.04.2025	5,08[6]	Morgan Stanley Basket MSNBUXOP[7]	246	0,00
3.959 USD	06.11.2024	5,11[6]	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY[7]	179	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Total Return Swap-Kontrakten ∞				**3.395.463**	**0,21**

[1] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-SOFR.

[2] Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Société Générale.

[3] Fester Zinssatz.

[4] Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

[5] Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist UBS AG.

[6] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-FEDEF.

[7] Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

[8] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-OBFR.

[9] Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

Correlation-Swap-Kontrakte 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,02 %)

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Korrelation zum Ausübungszeitpunkt in Prozent	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
5.000.000 USD	20.12.2024	BNP Paribas	Basket of S&P 500 /Nikkei 225 Index correlation swap 20/12/2024	80,50 %	379.911	0,02
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten ∞					**379.911**	**0,02**

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Inflation-Swap-Kontrakte 0,24 % (31. Dezember 2022: 0,03 %)

Vega Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Variance-Ausübungssatz	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
500.000 USD	19.01.2024	Citibank NA	CITI 19 Names US Basket	Verschiedene	1.146.934	0,07
325.000 USD	19.12.2025	Citibank NA	Russell 2000 Index vs S&P 500 Index	25 / 22,1	662.082	0,04
884.000 USD/ 638.000 USD	20.11.2024	Goldman Sachs International	GS 128 Pairwise Theta Flat CoVol	Verschiedene	364.531	0,02
250.000 EUR	21.03.2025	BNP Paribas	Euro Stoxx 50 Index vs FTSE 100 Index	16,00 / 15,05	349.372	0,02
400.000 USD	20.12.2024	UBS	UBS 35 Names US Basket	Verschiedene	247.689	0,02
400.000 USD	20.12.2024	Goldman Sachs International	Russell 2000 Index vs S&P 500 Index	25,69 / 28,15	167.030	0,01
250.000 USD	20.12.2024	UBS	UBS 50 Names Global Basket	Verschiedene	154.439	0,01
400.000 USD	20.12.2024	BNP Paribas	BNP US Geo Basket	Verschiedene	118.880	0,01
200.000 EUR	20.12.2024	BNP Paribas	IBEX 35 Index vs FTSE 100 Index	22,09 / 21,64	97.317	0,01
500.000 USD	19.12.2025	BNP Paribas	Euro Stoxx 50 Index vs S&P 500 Index	29,03 / 32,03	95.896	0,01
100.000 GBP	19.12.2025	BNP Paribas	DAX 40 Index vs FTSE 100 Index	16,60 / 14,40	87.982	0,01
240.000 USD	20.12.2024	Goldman Sachs International	Euro Stoxx 50 Index vs S&P 500 Index	22,00 / 24,35	85.377	0,01
125.000 USD	13.06.2025	BNP Paribas	S&P 500 Index vs Nikkei 225 Index	16,00 / 19,60	76.722	0,00
100.000 USD	23.02.2024	Goldman Sachs International	GS 5 Index Thematic	Verschiedene	65.476	0,00
100.000 USD	19.12.2025	BNP Paribas	Euro Stoxx 50 Index vs S&P 500 Index	27,55 / 30,7	29.861	0,00
300.000 EUR	31.07.2024	Goldman Sachs International	GS 6 Index Thematic	Verschiedene	28.314	0,00
75.000 EUR	19.12.2025	BNP Paribas	FTSE MIB Index vs Nikkei 225 Index	16,60 / 18,40	18.150	0,00
75.000 USD	17.01.2024	Goldman Sachs International	GS 5 Index Thematic	Verschiedene	16.837	0,00
500.000 USD	20.12.2024	Citibank NA	Russell 2000 Index vs Nasdaq-100 Index	33,80 / 34,00 / 35,00	15.323	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Variance-Swap-Kontrakten [∞]					**3.828.212**	**0,24**

Volatility-Swap-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,03 %)

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation[1]	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
110.000.000 EUR	20.06.2024	BNP	BNP 20 Names Slider European Basket	4.011.375	0,25
100.000.000 EUR	21.06.2024	BNP	BNP 30 Names Slider European Basket	3.108.949	0,19
75.000.000 EUR	21.06.2024	BNP	BNP 19 Names EU and US Slider Basket	2.376.298	0,15
174.971.819 USD	12.01.2024	Goldman Sachs International	GS 300 Pairwise Theta Flat CoVol[2]	1.112.751	0,07
30.000.000 USD	19.01.2024	UBS	UBS 29 Names US Basket	774.964	0,05
50.000.000 USD	17.01.2025	Citibank NA	CITI 21 Names US Basket	761.673	0,05
50.000.000 USD	19.01.2024	Citibank NA	CITI 18 Names US Basket	645.494	0,04
30.000.000 EUR	21.06.2024	BofA Securities	BAML 14 Names EU Basket	503.559	0,03
20.000.000 USD	19.01.2024	BofA Securities	BAML 17 Names US Basket	351.516	0,02
40.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 15 Names EU Basket	373.890	0,02
20.000.000 USD	19.01.2024	UBS	UBS 25 Names US Basket	334.327	0,02
30.000.000 USD	20.06.2025	Nomura	Nomura 20 Names Global Basket	320.322	0,02
25.000.000 USD	17.01.2025	BofA Securities	BAML 17 Names US Basket	309.864	0,02
60.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP Down Pairwise EU Basket	308.862	0,02

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Volatility-Swap-Kontrakte 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,03 %) (Fortsetzung)

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation[1]	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
20.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 10 Names EU Down Geo Basket	300.241	0,02
20.487.000 USD	21.06.2024	Société Générale	SG 15 Names Global Basket	291.000	0,02
6.000.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Basket	269.822	0,02
25.000.000 EUR	20.12.2024	BofA Securities	BAML 16 Names EU Basket	250.779	0,02
20.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 15 Names EU Basket	220.249	0,01
35.000.000 EUR	18.12.2026	BNP	BNP 25 Names EU Basket	223.579	0,01
20.000.000 USD	19.01.2024	UBS	UBS 10 Names US Vanilla Basket	216.868	0,01
20.000.000 USD	17.01.2025	Société Générale	SG 13 Names US Basket	212.000	0,01
20.000.000 USD	17.01.2025	UBS	UBS 17 Names US Basket	176.314	0,01
10.000.000 EUR	21.06.2024	Société Générale	SG 10 Names EU Basket	168.056	0,01
25.000.000 USD	17.01.2025	UBS	UBS 39 Names US Basket	156.013	0,01
12.500.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 20 Names EU Basket	140.967	0,01
10.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 20 Names EU Basket	140.278	0,01
7.500.000 USD	19.01.2024	UBS	UBS 39 Names US Basket	81.009	0,01
11.500.000 USD	20.12.2024	BNP	BNP 16 Names EU Basket	60.499	0,00
26.666.700 USD	20.12.2024	Société Générale	SG 15 Names Global Basket	56.000	0,00
125.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	9.683	0,00
125.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	9.683	0,00
125.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	9.683	0,00
6.250.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 20 Names EU Basket	38.851	0,00
10.000.000 EUR	20.06.2024	BNP	BNP 20 Names Slider European Basket	36.042	0,00
20.000.000 EUR	21.06.2024	BofA Securities	BAML 9 Names EU Basket	35.033	0,00
62.500 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	4.841	0,00
62.500 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 5 Names EU Down Geo Basket	4.841	0,00
25.000.000 USD	21.06.2024	Société Générale	SG 23 Names Global Basket	20.000	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten [∞]				**18.426.175**	**1,13**

[1]Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.

[2] Bei Volatilität gehandelter Dispersion-Swap.

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**1.476.262.171**	**90,75**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
520.000 AUD	356.981 US$	20.03.2024	BNP Paribas	2	(1.328)	(0,00)
1.400.000 AUD	134.195.056 ¥	21.03.2024	Citibank NA	9	(6.084)	(0,00)
460.000 AUD	315.117 US$	20.03.2024	Citibank NA	3	(499)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
600.000 AUD	411.324 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	3	(953)	(0,00)
560.000 AUD	53.949.139 ¥	21.03.2024	Deutsche Bank AG	6	(4.378)	(0,00)
80.480.000 AUD	7.762.281.522 ¥	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	(192.256)	(0,01)
18.800.000 AUD	16.963.635 CAD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(35.226)	(0,01)
1.840.000 AUD	176.573.551 ¥	21.03.2024	State Street Bank and Trust Co	12	(9.451)	(0,00)
190.000 AUD	130.214 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(264)	(0,00)
80.000 AUD	7.627.152 ¥	21.03.2024	UBS AG	1	(52)	(0,00)
1.290.000 AUD	884.525 US$	20.03.2024	UBS AG	7	(2.230)	(0,00)
1.560.000 BRL	319.658 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	3	(861)	(0,00)
4.370.758 BRL	900.000 US$	03.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(223)	(0,00)
1.410.000 BRL	288.978 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(835)	(0,00)
6.110.000 BRL	1.256.775 US$	20.03.2024	UBS AG	6	(8.154)	(0,00)
800.000 CAD	607.644 US$	20.03.2024	BNP Paribas	3	(292)	(0,00)
21.267.494 CAD	23.800.000 AUD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	(112.974)	(0,01)
54.400.000 CAD	5.850.958.426 ¥	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(287.394)	(0,02)
17.000.000 CHF	2.859.058.300 ¥	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(89.113)	(0,01)
54.710.000 CLP	63.354 US$	20.03.2024	BNP Paribas	1	(957)	(0,00)
694.722.130 CLP	800.000 US$	08.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(4.557)	(0,00)
345.310.200 CLP	400.000 US$	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(4.705)	(0,00)
523.900.623 CLP	600.000 US$	26.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(914)	(0,00)
44.890.000 CLP	51.607 US$	20.03.2024	Morgan Stanley	1	(409)	(0,00)
58.316.581 CNY	8.200.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(5.901)	(0,00)
386.206.891 COP	100.000 US$	02.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(973)	(0,00)
3.430.000 CZK	154.239 US$	20.03.2024	BNP Paribas	1	(1.083)	(0,00)
6.990.000 CZK	313.157 US$	20.03.2024	Citibank NA	2	(1.041)	(0,00)
1.190.000 CZK	53.289 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	(153)	(0,00)
3.700.000 CZK	165.601 US$	20.03.2024	UBS AG	1	(390)	(0,00)
577.439.993 EGP	14.152.941 US$	20.03.2024	Morgan Stanley	1	(989.980)	(0,06)
675.574 €	2.950.000 PLN	20.03.2024	Citibank NA	6	(797)	(0,00)
440.000 €	488.280 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	4	(708)	(0,00)
28.625.000 €	42.061.335 CAD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(272.971)	(0,02)
3.125.000 €	3.469.536 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(16.581)	(0,00)
24.625.000 €	278.305.652 SEK	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	(413.945)	(0,03)
27.375.000 €	44.726.571 AUD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	8	(278.218)	(0,02)
29.625.000 €	343.707.457 NOK	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	(1.115.893)	(0,07)
36.300.000 €	5.726.916.621 ¥	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	8	(557.524)	(0,04)
37.900.000 €	32.918.595 £	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(88.783)	(0,01)
6.250.000 €	5.897.417 CHF	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	8	(106.178)	(0,02)
1.500.000 €	1.668.357 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	10	(6.180)	(0,00)
80.000 €	89.023 US$	20.03.2024	UBS AG	1	(373)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
100.764 €	440.000 PLN	20.03.2024	UBS AG	2	(119)	(0,00)
40.000 £	51.026 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	(15)	(0,00)
20.000 £	25.553 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	(47)	(0,00)
3.250.000 £	3.564.701 CHF	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	(95.205)	(0,00)
50.125.000 £	9.203.746.161 ¥	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	9	(1.454.367)	(0,09)
375.000 £	480.174 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(2.106)	(0,00)
33.500.000 £	64.012.708 AUD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	7	(981.564)	(0,07)
54.176.422 £	63.100.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	(655.337)	(0,04)
160.000 £	204.422 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	5	(375)	(0,00)
840.400.605 HUF	2.200.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	(4.468)	(0,00)
9.160.000 HUF	26.420 US$	20.03.2024	UBS AG	1	(174)	(0,00)
267.520.000 INR	3.206.390 US$	20.03.2024	BNP Paribas	9	(2.920)	(0,00)
61.890.000 INR	741.979 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	4	(865)	(0,00)
66.545.509 INR	800.000 US$	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(678)	(0,00)
2.042.333.561 INR	24.583.739 US$	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	31	(59.647)	(0,00)
8.325.856 INR	100.000 US$	29.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(69)	(0,00)
137.170.000 INR	1.644.078 US$	20.03.2024	Royal Bank of Scotland	6	(1.508)	(0,00)
696.240.000 INR	8.360.837 US$	20.03.2024	UBS AG	10	(23.575)	(0,00)
39.938.618 ¥	420.000 AUD	21.03.2024	Barclays Bank Plc	3	(472)	(0,00)
17.210.000 ¥	123.688 US$	21.03.2024	Citibank NA	3	(105)	(0,00)
167.623.112 ¥	1.780.000 AUD	21.03.2024	Citibank NA	12	(13.785)	(0,00)
28.554.744 ¥	300.000 AUD	21.03.2024	Deutsche Bank AG	2	(143)	(0,00)
4.044.827.156 ¥	38.200.000 CAD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	(250.882)	(0,01)
3.839.276.046 ¥	43.200.000 NZD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	(89.994)	(0,00)
3.435.859.555 ¥	22.200.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	(131.625)	(0,01)
245.388.275 ¥	1.375.000 £	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(10.405)	(0,00)
6.816.536.700 ¥	71.680.000 AUD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	(517.470)	(0,02)
2.878.681.648 ¥	17.500.000 CHF	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	(366.045)	(0,02)
100.000.000 ¥	710.552 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(448)	(0,00)
17.907.612 ¥	190.000 AUD	21.03.2024	Royal Bank of Scotland	4	(1.363)	(0,00)
69.639.796 ¥	740.000 AUD	21.03.2024	State Street Bank and Trust Co	5	(6.062)	(0,00)
109.640.000 KRW	85.024 US$	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	(83)	(0,00)
239.570.000 KRW	185.632 US$	20.03.2024	BNP Paribas	1	(31)	(0,00)
183.700.000 KRW	143.152 US$	20.03.2024	Citibank NA	2	(835)	(0,00)
162.860.000 KRW	126.475 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	(303)	(0,00)
693.925.000 KRW	537.756 US$	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(2.255)	(0,00)
7.581.184.095 KRW	5.862.244 US$	18.01.2024	JPMorgan Chase Bank	11	(12.308)	(0,00)
337.120.000 KRW	261.601 US$	20.03.2024	UBS AG	2	(425)	(0,00)
2.860.000 MXN	167.392 US$	20.03.2024	BNP Paribas	1	(627)	(0,00)
6.745.000.000 NGN	7.100.000 US$	08.02.2024	Goldman Sachs International	1	(688.403)	(0,04)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
5.807.800.000 NGN	7.100.000 US$	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.009.617)	(0,06)
5.829.100.000 NGN	7.100.000 US$	22.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.103.697)	(0,07)
1.120.000 NOK	110.703 US$	20.03.2024	BNP Paribas	2	(229)	(0,00)
107.372.312 NOK	10.600.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(25.477)	(0,00)
700.000 NOK	69.086 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(40)	(0,00)
1.180.000 NOK	116.851 US$	20.03.2024	UBS AG	3	(458)	(0,00)
43.600.000 NZD	3.920.614.938 ¥	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(234.329)	(0,01)
66.187.356 NZD	61.822.457 AUD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	(286.447)	(0,02)
440.000 NZD	278.957 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	4	(319)	(0,00)
2.920.000 PHP	52.788 US$	20.03.2024	UBS AG	1	(77)	(0,00)
250.000 PLN	57.349 €	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	(40)	(0,00)
310.000 PLN	71.438 €	20.03.2024	Citibank NA	4	(410)	(0,00)
12.139.135 PLN	2.800.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(7.011)	(0,01)
190.000 PLN	43.647 €	20.03.2024	UBS AG	2	(99)	(0,00)
260.000 SEK	26.051 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	(173)	(0,00)
248.251.802 SEK	22.500.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	(221.041)	(0,01)
275.419.619 SEK	283.745.979 NOK	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	(607.846)	(0,05)
170.807.242 SEK	17.100.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	(146.527)	(0,01)
60.000 SGD	45.690 US$	20.03.2024	Citibank NA	1	(41)	(0,00)
28.054.230 SGD	21.300.000 US$	02.02.2024	HSBC Bank Plc	1	(598)	(0,00)
3.560.000 TRY	113.180 US$	20.03.2024	BNP Paribas	4	(1.083)	(0,00)
14.854.237 TRY	430.000 €	20.03.2024	Citibank NA	7	(8.759)	(0,00)
328.588.350 TRY	10.410.004 US$	20.03.2024	Citibank NA	6	(63.368)	(0,01)
1.340.000 TRY	42.747 US$	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	(553)	(0,00)
1.190.000 TRY	37.571 US$	20.03.2024	HSBC Bank Plc	1	(100)	(0,00)
316.600.125 TRY	10.050.000 US$	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(80.852)	(0,01)
10.428.690 TRY	300.000 €	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(4.057)	(0,00)
5.927.852 TRY	200.000 US$	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(453)	(0,00)
10.430.000 TRY	331.272 US$	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	5	(2.851)	(0,00)
102.749.060 TWD	3.400.000 US$	02.02.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(16.312)	(0,00)
21.300.000 US$	657.850.500 TWD	02.02.2024	Bank of America Merrill Lynch	1	(364.049)	(0,02)
1.884.240 US$	9.430.000 BRL	20.03.2024	Barclays Bank Plc	8	(42.846)	(0,00)
57.741 US$	75.120.000 KRW	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	(456)	(0,00)
955.376 US$	53.310.000 PHP	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	(6.964)	(0,00)
167.480 US$	148.980.000 CLP	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	(2.434)	(0,00)
31.022 US$	580.000 ZAR	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	(479)	(0,00)
154.781 US$	230.000 AUD	20.03.2024	Barclays Bank Plc	4	(2.527)	(0,00)
609.259 US$	480.000 £	20.03.2024	Barclays Bank Plc	13	(2.882)	(0,00)
87.577 US$	80.000 €	20.03.2024	Barclays Bank Plc	1	(1.073)	(0,00)
50.510 US$	80.000 NZD	20.03.2024	Barclays Bank Plc	2	(152)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
761.467 US$	13.500.000 MXN	20.03.2024	BNP Paribas	2	(25.710)	(0,00)
1.354.502 US$	14.860.000 NOK	20.03.2024	BNP Paribas	6	(111.258)	(0,01)
34.072 US$	50.000 AUD	20.03.2024	BNP Paribas	1	(126)	(0,00)
1.433.025 US$	50.410.000 THB	20.03.2024	BNP Paribas	3	(53.805)	(0,00)
615.039 US$	217.340.000 HUF	20.03.2024	BNP Paribas	2	(7.699)	(0,00)
550.141 US$	5.610.000 SEK	20.03.2024	BNP Paribas	2	(8.229)	(0,00)
35.477 US$	660.000 ZAR	20.03.2024	BNP Paribas	1	(369)	(0,00)
1.924.951 US$	107.450.000 PHP	20.03.2024	BNP Paribas	7	(14.713)	(0,00)
52.892 US$	210.000 PLN	20.03.2024	BNP Paribas	2	(457)	(0,00)
189.181 US$	250.000 SGD	20.03.2024	BNP Paribas	1	(1.022)	(0,00)
103.192 US$	8.620.000 INR	20.03.2024	BNP Paribas	2	(30)	(0,00)
16.865 US$	1.410.000 INR	20.03.2024	Citibank NA	1	(19)	(0,00)
62.578 US$	55.130.000 CLP	20.03.2024	Citibank NA	2	(299)	(0,00)
2.248.781 US$	3.010.000 SGD	20.03.2024	Citibank NA	4	(41.263)	(0,00)
100.783 US$	1.730.000 MXN	20.03.2024	Citibank NA	1	(93)	(0,00)
1.262.201 US$	13.750.000 NOK	20.03.2024	Citibank NA	6	(94.069)	(0,01)
522.810 US$	2.070.000 PLN	20.03.2024	Citibank NA	6	(3.048)	(0,00)
1.268.160 US$	24.290.000 ZAR	20.03.2024	Citibank NA	6	(51.075)	(0,00)
86.801 US$	140.000 NZD	20.03.2024	Citibank NA	3	(1.857)	(0,00)
488.163 US$	11.060.000 CZK	20.03.2024	Citibank NA	4	(5.686)	(0,00)
100.449 US$	131.870.000 KRW	20.03.2024	Citibank NA	1	(1.714)	(0,00)
553.701 US$	2.750.000 BRL	20.03.2024	Citibank NA	4	(8.281)	(0,00)
291.489 US$	430.000 AUD	20.03.2024	Citibank NA	5	(2.609)	(0,00)
281.720 US$	260.000 €	20.03.2024	Citibank NA	1	(6.391)	(0,00)
304.101 US$	240.000 £	20.03.2024	Citibank NA	7	(1.969)	(0,00)
460.227 US$	164.800.000 HUF	20.03.2024	Citibank NA	1	(11.969)	(0,00)
14.268.005 US$	1.193.550.000 INR	20.03.2024	Deutsche Bank AG	2	(24.393)	(0,00)
30.219 US$	120.000 PLN	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	(266)	(0,00)
117.731 US$	100.000 CHF	20.03.2024	Deutsche Bank AG	2	(2.036)	(0,00)
465.597 US$	430.000 €	20.03.2024	Deutsche Bank AG	1	(10.894)	(0,00)
420.091 US$	330.000 £	20.03.2024	Deutsche Bank AG	7	(755)	(0,00)
210.174 US$	320.000 AUD	20.03.2024	Deutsche Bank AG	2	(8.690)	(0,00)
652.445 US$	11.380.000 MXN	20.03.2024	Deutsche Bank AG	4	(11.117)	(0,00)
60.618 US$	8.650.000 ¥	21.03.2024	Deutsche Bank AG	2	(1.496)	(0,00)
2.304.816 US$	18.000.000 HKD	05.01.2024	Goldman Sachs International	1	(434)	(0,00)
1.829.520 US$	1.500.000 £	31.01.2024	Goldman Sachs International	1	(83.001)	(0,01)
35.500.000 US$	1.112.037.500 TWD	15.02.2024	Goldman Sachs International	1	(1.187.105)	(0,07)
2.352.117 US$	43.732.911 ZAR	09.01.2024	Goldman Sachs International	1	(38.119)	(0,00)
22.918.098 US$	21.600.000 €	31.01.2024	Goldman Sachs International	5	(970.976)	(0,06)
27.161.645 US$	25.150.000 €	05.01.2024	Goldman Sachs International	2	(622.423)	(0,04)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
20.808.048 US$	3.050.000.000 ¥	05.01.2024	Goldman Sachs International	2	(833.046)	(0,05)
14.200.000 US$	440.910.000 TWD	05.02.2024	HSBC Bank Plc	1	(325.885)	(0,02)
11.073.048 US$	211.308.226 ZAR	09.01.2024	HSBC Bank Plc	2	(476.071)	(0,03)
35.500.000 US$	1.096.417.500 TWD	02.02.2024	HSBC Bank Plc	2	(606.748)	(0,04)
21.300.000 US$	28.224.630 SGD	02.02.2024	HSBC Bank Plc	1	(128.773)	(0,01)
42.600.000 US$	1.340.835.000 TWD	16.02.2024	HSBC Bank Plc	1	(1.641.467)	(0,10)
580.840 US$	20.630.000 THB	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(27.637)	(0,00)
100.000 US$	35.166.840 HUF	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.534)	(0,00)
800.000 US$	66.801.011 INR	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	4	(2.391)	(0,00)
100.000 US$	3.116.993 TWD	22.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(2.451)	(0,00)
7.900.000 US$	245.468.800 TWD	26.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(173.841)	(0,01)
28.100.000 US$	299.143.435 NOK	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(1.361.033)	(0,09)
5.040.469 US$	156.216.668 TWD	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(91.491)	(0,00)
200.000 US$	265.286 SGD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(1.177)	(0,00)
1.100.000 US$	11.414.630 SEK	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	4	(32.959)	(0,00)
300.000 US$	1.202.454.289 COP	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(9.896)	(0,00)
4.474.651 US$	16.556.207 ILS	16.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(124.146)	(0,01)
300.000 US$	1.187.997 PLN	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(2.093)	(0,00)
28.452.563 US$	43.214.397 AUD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(1.041.473)	(0,06)
12.200.000 US$	362.870.789 TRY	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(15.215)	(0,00)
37.579.351 US$	34.625.000 €	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	8	(679.389)	(0,04)
100.000 US$	402.725.559 COP	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(3.766)	(0,00)
819.361 US$	15.640.000 ZAR	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(30.077)	(0,00)
227.232 US$	81.170.000 HUF	20.03.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(5.342)	(0,00)
11.500.000 US$	216.888.751 ZAR	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	4	(353.156)	(0,02)
3.205.724 US$	267.415.385 INR	04.01.2024	JPMorgan Chase Bank	4	(7.700)	(0,00)
28.815.070 US$	2.403.959.724 INR	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	22	(61.762)	(0,00)
700.000 US$	618.446.849 CLP	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(8.024)	(0,00)
4.338.096 US$	3.750.000 CHF	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	(120.691)	(0,01)
118.849.824 US$	160.900.000 CAD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	9	(3.187.138)	(0,20)
361.362 US$	1.760.560 BRL	02.02.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(443)	(0,00)
1.010.440 US$	30.728.832 TWD	05.02.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(1.929)	(0,00)
11.198.376 US$	934.029.013 INR	08.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(23.070)	(0,00)
3.400.000 US$	283.594.000 INR	05.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(7.653)	(0,00)
900.000 US$	1.170.197.770 KRW	05.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(6.829)	(0,00)
22.301.115 US$	110.097.505 BRL	03.01.2024	JPMorgan Chase Bank	92	(363.882)	(0,02)
400.000 US$	1.593.776.409 COP	09.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(10.923)	(0,00)
34.100.000 US$	243.583.959 CNY	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	14	(126.133)	(0,01)
11.300.000 US$	41.991.862 ILS	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(362.297)	(0,02)
100.000 US$	8.343.400 INR	18.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(191)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
18.504.100 US$	1.542.613.058 INR	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	4	(19.411)	(0,00)
51.565.942 US$	7.437.500.000 ¥	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	12	(1.248.023)	(0,08)
3.400.000 US$	4.480.537.741 KRW	04.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(75.537)	(0,01)
200.000 US$	259.985.545 KRW	08.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(882)	(0,00)
19.565.754 US$	31.800.000 NZD	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(568.971)	(0,04)
200.000 US$	805.040.199 COP	05.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(7.725)	(0,00)
100.000 US$	3.117.214 TWD	08.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(2.051)	(0,00)
200.000 US$	6.269.233 TWD	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	2	(5.669)	(0,00)
200.000 US$	6.230.825 TWD	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(4.444)	(0,00)
200.000 US$	797.206.225 COP	19.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(5.074)	(0,00)
7.393.587 US$	229.241.202 TWD	04.01.2024	JPMorgan Chase Bank	6	(82.930)	(0,00)
25.862.481 US$	20.454.545 £	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	12	(213.965)	(0,01)
15.980.830 US$	1.333.939.579 INR	16.01.2024	JPMorgan Chase Bank	3	(39.113)	(0,00)
600.000 US$	792.673.690 KRW	11.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(11.325)	(0,00)
3.400.000 US$	4.454.546.006 KRW	16.01.2024	JPMorgan Chase Bank	17	(36.765)	(0,00)
7.900.000 US$	247.880.704 TWD	16.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(239.030)	(0,01)
100.000 US$	403.803.102 COP	16.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(3.947)	(0,00)
100.000 US$	395.744.000 COP	18.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.825)	(0,00)
600.000 US$	779.862.000 KRW	12.01.2024	JPMorgan Chase Bank	1	(1.491)	(0,00)
11.120.269 US$	192.821.915 MXN	10.01.2024	JPMorgan Chase Bank	5	(253.709)	(0,01)
10.981.000 US$	10.000.000 €	22.03.2024	NIPB	2	(101.125)	(0,01)
3.431.430 US$	2.700.000 £	22.03.2024	NIPB	1	(11.885)	(0,00)
569.967 US$	31.860.000 PHP	20.03.2024	Royal Bank of Scotland	1	(5.163)	(0,00)
138.289 US$	120.000 CHF	20.03.2024	Royal Bank of Scotland	4	(5.432)	(0,00)
69.158 US$	110.000 NZD	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(501)	(0,00)
466.076 US$	370.000 £	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	10	(5.781)	(0,00)
88.520 US$	130.000 AUD	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(393)	(0,00)
158.292 US$	630.000 PLN	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	4	(1.752)	(0,00)
1.299.953 US$	1.200.000 €	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	4	(29.788)	(0,00)
133.156 US$	2.320.000 MXN	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(2.122)	(0,00)
78.142 US$	101.460.000 KRW	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(461)	(0,00)
254.585 US$	1.260.000 BRL	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	3	(2.904)	(0,00)
78.794 US$	1.790.000 CZK	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(1.133)	(0,00)
75.866 US$	100.000 SGD	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(215)	(0,00)
18.910 US$	6.600.000 HUF	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(1)	(0,00)
1.507.057 US$	1.280.000 CHF	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	21	(25.967)	(0,00)
41.892 US$	780.000 ZAR	20.03.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(471)	(0,00)
226.309 US$	32.430.000 ¥	21.03.2024	UBS AG	1	(6.567)	(0,00)
129.313 US$	168.890.000 KRW	20.03.2024	UBS AG	2	(1.530)	(0,00)
1.031.106 US$	57.590.000 PHP	20.03.2024	UBS AG	3	(8.497)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (3,25 %) (31. Dezember 2022: (1,21 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
167.095 US$	1.730.000 SEK	20.03.2024	UBS AG	3	(5.093)	(0,00)
1.207.024 US$	42.730.000 THB	20.03.2024	UBS AG	2	(53.287)	(0,00)
1.152.542 US$	970.000 CHF	20.03.2024	UBS AG	9	(9.201)	(0,00)
1.350.450 US$	1.830.000 CAD	20.03.2024	UBS AG	3	(38.867)	(0,00)
697.731 US$	58.300.000 INR	20.03.2024	UBS AG	1	(393)	(0,00)
22.250.000 ZAR	1.217.061 US$	20.03.2024	BNP Paribas	4	(8.623)	(0,00)
14.300.000 ZAR	777.396 US$	20.03.2024	Citibank NA	2	(738)	(0,00)
Abgesicherte Klassen CHF						
1.802.368 US$	1.612.823 CHF	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	2	(117.022)	(0,01)
159.419 US$	141.135 CHF	18.01.2024	UBS AG	9	(8.544)	(0,00)
2.404.656 US$	2.143.722 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	23	(146.544)	(0,01)
Abgesicherte Klassen EUR						
241 €	268 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(1)	(0,00)
764.529 US$	702.835 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(12.341)	(0,00)
2.681.425 US$	2.518.463 €	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(102.326)	(0,01)
3.831.164 US$	3.580.409 €	18.01.2024	UBS AG	6	(126.396)	(0,01)
13.211.705 US$	12.267.274 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	74	(347.776)	(0,02)
Abgesicherte Klassen GBP						
32.120.603 £	41.008.739 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(57.804)	(0,00)
9.200.888 US$	7.591.110 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(477.107)	(0,03)
44.360.580 US$	35.665.365 £	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	4	(1.109.612)	(0,07)
23.928.056 US$	19.460.251 £	18.01.2024	UBS AG	2	(882.048)	(0,05)
446.445.225 US$	363.121.258 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	70	(16.502.342)	(1,02)
Abgesicherte Klassen JPY						
302.522 US$	43.430.025 ¥	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(6.279)	(0,00)
1.026.659 US$	150.358.322 ¥	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	5	(42.436)	(0,00)
1.111.191 US$	165.071.219 ¥	18.01.2024	UBS AG	6	(62.518)	(0,00)
280.886 US$	40.997.626 ¥	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(10.620)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SGD						
93 US$	126 SGD	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(3)	(0,00)
63 US$	83 SGD	18.01.2024	State Street Bank and Trust Co	1	(0)	(0,00)
103 US$	140 SGD	18.01.2024	UBS AG	1	(3)	(0,00)
62.703 US$	85.396 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	19	(2.081)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞]					**(53.084.382)**	**(3,25)**

Futures-Kontrakte (1,51 %) (31. Dezember 2022: (0,81 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
300	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 95.00	(309)	0,00
300	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future January 2024, Strike Price EUR 95.38	(2.364)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte (1,51 %) (31. Dezember 2022: (0,81 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
300	3-Month Euro EURIBOR Call Option on Future January 2024, Strike Price EUR 97.38	(2.364)	(0,00)
3.000	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future March 2024, Strike Price EUR 96.00	(82.907)	(0,01)
1.500	3-Month Euro EURIBOR Put Option on Future March 2024, Strike Price EUR 96.25	(225.842)	(0,01)
(38)	3 Month SOFR Future June 2024	(25.175)	(0,00)
(26)	3 Month SOFR Future March 2024	(1.462)	(0,00)
(718)	3 Month SOFR Future March 2025	(778.467)	(0,05)
(76)	3 Month SOFR Future September 2025	(21.875)	(0,00)
(2.072)	30 Day Federal Funds Future February 2024	(107.984)	(0,01)
(674)	3-Month Euro EURIBOR Future December 2024	(1.597.701)	(0,10)
(33)	90-Day Bank Bill Future December 2024	(17.506)	(0,00)
(1.312)	Australian Dollar Currency Future March 2024	(2.906.134)	(0,19)
(183)	Australian Government Bond 10-Year Future March 2024	(170.450)	(0,01)
(301)	Australian Government Bond 3-Year Future March 2024	(165.734)	(0,01)
(106)	Bankers Acceptance Future December 2024	(204.829)	(0,01)
(1.744)	Bankers Acceptance Future March 2024	(319.079)	(0,02)
(202)	BIST 30 Index Future February 2024	(3.283)	(0,00)
9	Brazil Real Currency Future January 2024	(184.281)	(0,01)
(1.194)	British Pound Currency Future March 2024	(631.877)	(0,04)
467	CAC40 Index Future January 2024	(267.510)	(0,02)
(2.376)	Canadian 10-Year Bond Future March 2024	(253.276)	(0,02)
(4)	Canadian 5-Year Bond Future March 2024	(394)	(0,00)
953	Canadian Dollar Currency Future March 2024	(150.781)	(0,01)
47	DAX Index Future March 2024	(155.314)	(0,01)
(2)	E-mini Health Care Future March 2024	(4.460)	(0,00)
(15)	E-mini Russell 2000 Index Future March 2024	(80.063)	(0,01)
1	E-mini Utilities Future March 2024	(180)	(0,00)
1.035	Euro Bund Call Option on Future February 2024, Strike Price EUR 139.00	(114.478)	(0,01)
225	Euro Bund Call Option on Future February 2024, Strike Price EUR 142.00	(9.167)	(0,00)
224	Euro Bund Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 132.00	(9.567)	(0,00)
(75)	Euro-Buxl Put Option on Future February 2024, Strike Price EUR 135.00	(33.575)	(0,01)
(1.050)	Euro FX Currency Future March 2024	(2.582.758)	(0,17)
295	Euro Stoxx 50 Future March 2024	(147.703)	(0,01)
(5)	Euro/Pound Sterling Currency Future March 2024	(3.426)	(0,00)
7	Euro-BTP Future January 2024	(528)	(0,00)
(368)	Euro-BTP Future March 2024	(1.206.631)	(0,07)
1.374	Euro-Bund Future March 2024	(1.382.323)	(0,08)
(396)	Euro-OAT Future March 2024	(154.660)	(0,01)
(13)	FTSE 100 Index Future March 2024	(22.475)	(0,00)
(344)	FTSE China A50 Index Future January 2024	(108.495)	(0,01)
(34)	FTSE/JSE Top 40 Index Future March 2024	(29.154)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte (1,51 %) (31. Dezember 2022: (0,81 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
31	FTSE/MIB Index Future March 2024	(26.169)	(0,00)
119	IFSC Nifty50 Index Future January 2024	(3.927)	(0,00)
(67)	Hang Seng China Enterprises Index Future January 2024	(87.193)	(0,01)
(23)	Hang Seng Index Future January 2024	(48.440)	(0,00)
(8)	Hang Seng TECH Index Future January 2024	(6.935)	(0,00)
14	IBEX 35 Index Future January 2024	(7.298)	(0,00)
2	IBEX 35 Mini Index Future January 2024	(209)	(0,00)
(116)	Japan Government 10-Year Bond (OSE) Future March 2024	(215.562)	(0,01)
(87)	Japanese Yen Currency Future March 2024	(214.716)	(0,01)
370	KOSPI 200 Index Future December 2049	(16.558)	(0,00)
2	Long Swiss Confederation Bond Future March 2024	(582)	(0,00)
4	Mini-DAX Future March 2024	(1.469)	(0,00)
(4)	Mini-Hang Seng China Enterprises Index Future January 2024	(1.122)	(0,00)
(83)	Mini-Hang Seng Index Future January 2024	(54.597)	(0,00)
(1)	MSCI China A 50 Index Future January 2024	(945)	(0,00)
(26)	MSCI Emerging Markets Index Future March 2024	(25.610)	(0,00)
(28)	MSCI Singapore Index Future January 2024	(20.048)	(0,00)
(1.382)	New Zealand Dollar Currency Future March 2024	(918.250)	(0,05)
17	Nikkei 225 (OSE) Future March 2024	(89.516)	(0,00)
9	Norwegian Krone Currency Future March 2024	(65.198)	(0,00)
(4)	S&P 500 Consumer Staples Index March 2024	(8.310)	(0,00)
(100)	S&P 500 E-mini Future March 2024	(86.296)	(0,01)
(120)	S&P/TSX 60 Index Future March 2024	(124.283)	(0,01)
(3)	South African Rand Currency (CME) Future March 2024	(300)	(0,00)
(895)	SPI 200 Index Future March 2024	(870.235)	(0,05)
66	STOXX Europe 600 Index Future March 2024	(10.127)	(0,00)
2	STOXX Europe 600 Insurance Future March 2024	(663)	(0,00)
3	STOXX Europe 600 Utilities March 2024	(1.823)	(0,00)
5	Swedish Krona Currency Future March 2024	(17.995)	(0,00)
(96)	Swiss Franc Currency Future March 2024	(422.703)	(0,03)
(1)	TAIEX Future January 2024	(91)	(0,00)
(163)	Techpoint Inc Future January 2024	(29.284)	(0,00)
463	United Kingdom Long Gilt Future March 2024	(588.638)	(0,04)
(2.782)	US Treasury 10-Year Note (CBT) Future March 2024	(5.306.058)	(0,32)
(88)	US Treasury 10-Year Ultra Future March 2024	(97.547)	(0,01)
(8)	US Treasury 3-Year Note (CBT) Future	(1.523)	(0,00)
(1.153)	US Treasury 2-Year Note (CBT) Future March 2024	(1.025.246)	(0,05)
(39)	US Treasury Ultra Bond (CBT) Future March 2024	(3.063)	(0,00)
(116)	WIG 20 Index Future December 2049	(10.313)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Futures-Kontrakte (1,51 %) (31. Dezember 2022: (0,81 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(81)	Yen Denominated Nikkei Future March 2024	(18.015)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(24.593.398)**	**(1,51)**

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %))

Anzahl Kontrakte/Nominal-wert Betrag	Fällig-keit	Art	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Kaufoptionen				
(130.036)	01.08.2028	Advanced Energy Industries Inc, Strike Price $137.46 ∞	(4.053.943)	(0,25)
(121.230)	29.01.2029	Akamai Technologies Inc, Strike Price $126.31 ∞	(4.304.190)	(0,27)
(125.000)	15.08.2025	Akamai Technologies Inc, Strike Price $95.00 ∞	(4.417.445)	(0,27)
(400.000)	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price $37.87 ∞	(8.996.424)	(0,56)
(1.509)	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price $55.00 ±	(1.418.460)	(0,09)
(1.575.000)	15.01.2027	BridgeBio Pharma Inc, Strike Price $42.71 ∞	(24.596.436)	(1,51)
(1.575.000)	19.02.2027	BridgeBio Pharma Inc, Strike Price $42.71 ∞	(25.021.546)	(1,54)
(450.000)	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price $92.30 ∞	(14.676)	(0,00)
(117.000)	20.11.2026	Confluent Inc, Strike Price $100.06 ∞	(121.305)	(0,01)
(117.000)	18.12.2026	Confluent Inc, Strike Price $100.06 ∞	(130.196)	(0,01)
(116.000)	15.01.2027	Confluent Inc, Strike Price $100.06 ∞	(138.561)	(0,01)
(210.000)	15.01.2027	Conmed Corp, Strike Price $139.47 ∞	(4.241.190)	(0,26)
(1.395.000)	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 ∞	(9.187.405)	(0,56)
(1.395.000)	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR15.50 ∞	(9.351.603)	(0,57)
(47.396)	21.06.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR26.00 ±	(104.712)	(0,01)
(5.000)	15.09.2025	Energizer Holdings Inc, Strike Price EUR15.53 ∞	(877.248)	(0,05)
(334.375)	29.08.2028	Enovis Corp, Strike Price $58.32 ∞	(6.717.903)	(0,41)
(110.000)	17.09.2027	Envestnet Inc, Strike Price $73.37 ∞	(1.090.872)	(0,07)
(110.000)	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price $73.37 ∞	(1.112.837)	(0,07)
(110.000)	19.11.2027	Envestnet Inc, Strike Price $73.37 ∞	(1.140.124)	(0,07)
(300.000)	15.06.2029	Fluor Corp, Strike Price $45.50 ∞	(4.241.207)	(0,26)
(300.000)	13.07.2029	Fluor Corp, Strike Price $45.50 ∞	(4.281.748)	(0,26)
(300.000)	13.08.2029	Fluor Corp, Strike Price $45.50 ∞	(4.327.153)	(0,27)
(200.000)	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price $94.61 ∞	(23)	(0,00)
(7)	19.01.2024	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD5,800.00 ±	(5.872)	(0,00)
(547)	19.01.2024	Hang Seng China Enterprises Index, Strike Price HKD6,900.00 ±	(7.005)	(0,00)
(50.000)	17.07.2026	Insulet Corp, Strike Price $225.00 ∞	(3.285.596)	(0,20)
(28)	11.01.2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW340.00 ±	(109.791)	(0,01)
(4)	11.01.2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW345.00 ±	(12.773)	(0,00)
(23)	11.01.2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW350.00 ±	(53.576)	(0,00)
(80.000)	15.12.2028	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price $108.00 ∞	(2.381.977)	(0,15)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert Betrag	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufoptionen (Fortsetzung)				
(800.000)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $32.49 ∞	(1.067)	(0,00)
(1.000.000)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $40.00 ∞	(426)	(0,00)
(180)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $60.00 ±	(540)	(0,00)
(91)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $47.50 ±	0	0,00
(283.302)	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price $133.17 ∞	(1.154)	(0,00)
(240.000)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $110.53 ∞	(8)	(0,00)
(11)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $115.00 ±	0	0,00
(400.000)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $116.99 ∞	(9)	(0,00)
(350.000)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $144.62 ∞	(3)	(0,00)
(132)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $170.00 ±	0	0,00
(238)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $220.00 ±	0	0,00
(175)	17.01.2025	MetLife Inc, Strike Price $70.00 ±	(91.000)	(0,01)
(112.500)	18.07.2025	Middleby Corp, Strike Price $130.00 ∞	(4.078.606)	(0,25)
(200.000)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price $172.18 ∞	(664)	(0,00)
(250.000)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price $173.89 ∞	(774)	(0,00)
(133)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price $250.00 ±	0	0,00
(446.500)	09.02.2029	ON Semiconductor Corp, Strike Price $103.87 ∞	(13.837.402)	(0,85)
(446.500)	16.02.2029	ON Semiconductor Corp, Strike Price $103.87 ∞	(13.872.919)	(0,85)
(139)	15.03.2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price $4,400.00 ±	(3.051.050)	(0,19)
(151)	15.03.2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price $4,600.00 ±	(1.979.987)	(0,12)
(173)	15.03.2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price $4,650.00 ±	(1.913.812)	(0,12)
(4)	15.03.2024	S&P 500 E-mini Call Option on Future, Strike Price $4,800.00 ±	(22.850)	(0,00)
(3)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,975.00 ±	(242.910)	(0,02)
(5)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,025.00 ±	(379.950)	(0,02)
(7)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,050.00 ±	(514.430)	(0,03)
(7)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,100.00 ±	(479.710)	(0,03)
(12)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,150.00 ±	(762.120)	(0,05)
(3)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,275.00 ±	(153.465)	(0,01)
(10)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,325.00 ±	(582.500)	(0,04)
(38)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,375.00 ±	(1.565.790)	(0,10)
(11)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,375.00 ±	(592.680)	(0,04)
(18)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,475.00 ±	(563.850)	(0,03)
(17)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,500.00 ±	(490.790)	(0,03)
(3)	20.12.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,500.00 ±	(173.910)	(0,01)
(17)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,550.00 ±	(406.300)	(0,03)
(30)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,550.00 ±	(1.183.350)	(0,07)
(1)	18.10.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,600.00 ±	(45.625)	(0,00)
(5)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,700.00 ±	(51.525)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert Betrag	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Kaufoptionen (Fortsetzung)				
(13)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,750.00 ±	(86.255)	(0,01)
(24)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,775.00 ±	(547.920)	(0,03)
(20)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,800.00 ±	(424.800)	(0,03)
(13)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,850.00 ±	(23.920)	(0,00)
(11)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,875.00 ±	(13.420)	(0,00)
(21)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,900.00 ±	(16.275)	(0,00)
(8)	20.12.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,900.00 ±	(244.880)	(0,02)
(15)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,950.00 ±	(4.275)	(0,00)
(56)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $5,000.00 ±	(580.440)	(0,04)
(47)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $5,200.00 ±	(705)	(0,00)
(19)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $5,200.00 ±	(75.430)	(0,00)
(1)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $5,210.00 ±	(15)	(0,00)
(18)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $5,250.00 ±	(54.360)	(0,00)
(125)	16.02.2024	S&P 500 Index, Strike Price $5,300.00 ±	(5.937)	(0,00)
(6)	20.12.2024	S&P 500 Index, Strike Price $5,300.00 ±	(68.460)	(0,00)
(21)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $5,500.00 ±	(14.805)	(0,00)
(4.000)	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price $100.00 ±	(1.580.000)	(0,10)
(2.490)	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price $120.00 ±	(143.175)	(0,01)
(190)	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price $125.00 ±	(9.500)	(0,00)
(400.000)	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price $72.73 ∞	(9.641.377)	(0,60)
(216.740)	01.05.2028	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price $82.47 ∞	(5.154.054)	(0,32)
(400.000)	21.01.2028	Semtech Corp, Strike Price $37.00 ∞	(2.815.662)	(0,17)
(750)	19.07.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $105.00 ±	(69.375)	(0,00)
(2.090)	19.07.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $67.88 ∞	(2.989.618)	(0,18)
(53)	19.01.2024	Signet Jewelers Ltd, Strike Price $110.00 ±	(17.225)	(0,00)
(894.454)	28.02.2030	Stem Inc, Strike Price $7.13 ∞	(2.125.843)	(0,13)
(400.000)	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price $33.27 ∞	(5.369)	(0,00)
(127.138)	17.07.2028	Tetra Tech Inc, Strike Price $196.64 ∞	(4.556.180)	(0,28)
(312.085)	21.06.2024	T-Mobile US Inc, Strike Price $121.54 ∞	(12.731.105)	(0,78)
(180.000)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $164.89 ∞	(108)	(0,00)
(160.000)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $198.27 ∞	(27)	(0,00)
(200.000)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $199.22 ∞	(32)	(0,00)
(15)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $320.00 ±	0	0,00
(818.777)	25.10.2028	Wayfair Inc, Strike Price $45.80 ∞	(33.750.071)	(2,08)
(249.066)	16.10.2028	Western Digital Corp, Strike Price $52.20 ∞	(5.074.562)	(0,31)
(120.000)	19.10.2029	Wolfspeed Inc, Strike Price $120.00 ∞	(2.083.353)	(0,13)
1.000.000	10.02.2025	Worst of autocallable on S&P 500® Index ("SPX"), Russell 2000® Index ("RTY"), Nasdaq-100 Index® ("NDX"), Strike Price $1.00 ∞	(19.996)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert Betrag	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen				
(100)	14.06.2024	3 Month SOFR Future, Strike Price $94.50 ±	(5.625)	(0,00)
(20.806)	09.09.2024	Advanced Energy Industries Inc, Strike Price $111.45 ∞	(263.882)	(0,02)
(53.892)	15.08.2025	Akamai Technologies Inc, Strike Price $104.07 ∞	(302.947)	(0,02)
(33.950)	21.08.2024	Akamai Technologies Inc, Strike Price $109.08 ∞	(140.850)	(0,01)
(46.946)	19.01.2024	Apellis Pharmaceuticals Inc, Strike Price $42.97 ∞	(45.573)	(0,00)
(474.110)	19.02.2027	BridgeBio Pharma Inc, Strike Price $38.73 ∞	(5.296.378)	(0,33)
(126.665)	19.01.2024	Ceridian HCM Holding Inc, Strike Price $105.13 ∞	(4.768.471)	(0,29)
(11.700)	20.11.2026	Confluent Inc, Strike Price $76.14 ∞	(547.134)	(0,03)
(11.700)	18.12.2026	Confluent Inc, Strike Price $76.28 ∞	(547.813)	(0,03)
(11.600)	15.01.2027	Confluent Inc, Strike Price $76.41 ∞	(543.712)	(0,03)
(70.547)	15.01.2027	Conmed Corp, Strike Price $110.88 ∞	(1.475.496)	(0,09)
(1.448.995)	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR10.99 ∞	(45.360)	(0,00)
(1.448.995)	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR10.99 ∞	(93.882)	(0,01)
(1.448.995)	20.12.2024	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11.83 ∞	(63.426)	(0,00)
(1.448.995)	21.03.2025	Deutsche Telekom AG, Strike Price EUR11.83 ∞	(122.799)	(0,01)
(103.656)	30.10.2024	Enovis Corp, Strike Price $47.45 ∞	(347.132)	(0,02)
(92.400)	15.10.2027	Envestnet Inc, Strike Price $72.69 ∞	(2.121.267)	(0,13)
(14)	19.01.2024	Euro Stoxx 50 Index, Strike Price EUR4,550.00 ±	(9.697)	(0,00)
(173.640)	09.08.2024	Fluor Corp, Strike Price $36.19 ∞	(437.033)	(0,03)
(29.267)	19.01.2024	Guardant Health Inc, Strike Price $107.62 ∞	(2.346.703)	(0,15)
(10.659)	17.07.2026	Insulet Corp, Strike Price $321.48 ∞	(1.129.954)	(0,07)
(57)	11.01.2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW340.00 ±	(4.315)	(0,00)
(33)	11.01.2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW350.00 ±	(8.840)	(0,00)
(14)	11.01.2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW355.00 ±	(7.202)	(0,00)
(11)	08.02.2024	KOSPI 200 Index, Strike Price KRW360.00 ±	(15.758)	(0,00)
(12.952)	15.12.2028	Live Nation Entertainment Inc, Strike Price $101.56 ∞	(279.786)	(0,02)
(168.821)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $41.56 ∞	(4.460.627)	(0,28)
(214.527)	19.01.2024	Lyft Inc, Strike Price $56.35 ∞	(8.829.312)	(0,54)
(78.605)	19.01.2024	Marriott Vacations Worldwide Corp, Strike Price $148.83 ∞	(4.985.510)	(0,30)
(76.632)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $125.67 ∞	(6.796.674)	(0,42)
(124.502)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $132.97 ∞	(11.947.871)	(0,73)
(103.560)	19.01.2024	Match Group Inc, Strike Price $163.96 ∞	(13.135.585)	(0,81)
(175)	17.01.2025	MetLife Inc, Strike Price $65.00 ±	(95.375)	(0,01)
(45.713)	18.07.2025	Middleby Corp, Strike Price $150.83 ∞	(775.376)	(0,05)
(49.339)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price $220.35 ∞	(6.366.855)	(0,39)
(64.205)	19.01.2024	Okta Inc, Strike Price $222.80 ∞	(8.441.925)	(0,52)
(151.810)	28.02.2024	ON Semiconductor Corp, Strike Price $82.83 ∞	(795.922)	(0,05)
(75.000)	21.11.2025	Palo Alto Networks Inc, Strike Price $193.96 ∞	(1.033.026)	(0,06)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert Betrag	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
(750.000)	16.05.2025	Palo Alto Networks Inc, Strike Price $99.20 ∞	(1.167.145)	(0,07)
(122)	17.07.2024	POSCO Holdings Inc, Strike Price KRW488,000.00 ∞	(4.256)	(0,00)
(118)	31.01.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,100.00 ±	(10.325)	(0,00)
(73)	19.01.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,670.00 ±	(36.500)	(0,00)
(3)	19.01.2024	S&P 500 E-mini Put Option on Future, Strike Price $4,830.00 ±	(7.650)	(0,00)
(12)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $2,550.00 ±	(72)	(0,00)
(10)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,000.00 ±	(100)	(0,00)
(54)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,025.00 ±	(38.070)	(0,00)
(78)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,050.00 ±	(780)	(0,00)
(45)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,050.00 ±	(32.625)	(0,00)
(20)	20.12.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,100.00 ±	(48.400)	(0,00)
(131)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,175.00 ±	(112.005)	(0,01)
(18)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,375.00 ±	(360)	(0,00)
(19)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,425.00 ±	(475)	(0,00)
(22)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,450.00 ±	(550)	(0,00)
(23)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,475.00 ±	(575)	(0,00)
(24)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,525.00 ±	(720)	(0,00)
(7)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,625.00 ±	(280)	(0,00)
(37)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,675.00 ±	(63.455)	(0,00)
(75)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,725.00 ±	(3.750)	(0,00)
(30)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,725.00 ±	(55.500)	(0,00)
(15)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,750.00 ±	(825)	(0,00)
(14)	20.12.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,800.00 ±	(83.090)	(0,01)
(87)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,875.00 ±	(205.320)	(0,01)
(11)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $3,975.00 ±	(935)	(0,00)
(11)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,025.00 ±	(1.045)	(0,00)
(14)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,050.00 ±	(1.400)	(0,00)
(12)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,100.00 ±	(1.320)	(0,00)
(8)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,150.00 ±	(960)	(0,00)
(1)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,265.00 ±	(153)	(0,00)
(4)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,275.00 ±	(620)	(0,00)
(20)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,325.00 ±	(107.400)	(0,01)
(37)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,375.00 ±	(7.400)	(0,00)
(16)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,375.00 ±	(94.960)	(0,01)
(51)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,425.00 ±	(11.985)	(0,00)
(1)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,435.00 ±	(247)	(0,00)
(1)	18.10.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,500.00 ±	(12.525)	(0,00)
(9)	20.12.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,500.00 ±	(137.925)	(0,01)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (23,28 %) (31. Dezember 2022: (9,90 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte/ Nominalwert Betrag	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
(39)	21.06.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,550.00 ±	(331.890)	(0,02)
(48.561)	19.01.2024	Sarepta Therapeutics Inc, Strike Price $82.73 ∞	(45.362)	(0,00)
(36.846)	09.09.2024	Seagate Technology Holdings Plc, Strike Price $64.30 ∞	(83.568)	(0,01)
(58.277)	21.01.2028	Semtech Corp, Strike Price $41.74 ∞	(1.167.564)	(0,07)
(1.050)	21.06.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $66.42 ∞	(520.423)	(0,03)
(1.050)	19.07.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $66.42 ∞	(567.981)	(0,04)
(1.050)	16.08.2024	Shift4 Payments Inc, Strike Price $66.42 ∞	(611.055)	(0,04)
(49.453)	11.01.2024	SK Hynix Inc, Strike Price KRW88,200.00 ∞	(0)	(0,00)
(89.445)	01.04.2024	Stem Inc, Strike Price $5.87 ∞	(192.191)	(0,01)
(67.492)	19.01.2024	Sunnova Energy International Inc, Strike Price $37.85 ∞	(1.516.909)	(0,09)
(34.900)	19.08.2024	Tetra Tech Inc, Strike Price $165.63 ∞	(395.576)	(0,02)
(400.000)	21.06.2024	T-Mobile US Inc, Strike Price $115.88 ∞	(207.835)	(0,01)
(41.564)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $210.42 ∞	(6.154.805)	(0,38)
(37.717)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $252.89 ∞	(7.181.038)	(0,44)
(49.550)	19.01.2024	Wayfair Inc, Strike Price $253.24 ∞	(9.451.231)	(0,58)
(114.629)	13.05.2024	Wayfair Inc, Strike Price $38.47 ∞	(231.318)	(0,01)
(41.096)	07.11.2024	Western Digital Corp, Strike Price $42.46 ∞	(102.352)	(0,01)
(21.739)	19.10.2029	Wolfspeed Inc, Strike Price $107.31 ∞	(1.355.828)	(0,08)
Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt ± (Prämie: 504.667.233 US$)			**(378.717.224)**	**(23,28)**

Die Gegenparteien von OTC-Optionskontrakten sind Goldman Sachs International und JPMorgan Chase Bank.

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %))

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
36.562	10X Genomics Inc Class A	Morgan Stanley	(17.160)	(0,00)
(6.925)	4D Molecular Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(3.265)	(0,00)
(295.384)	89bio Inc	Morgan Stanley	(112.920)	(0,01)
2.169	A10 Networks Inc	Morgan Stanley	(259)	(0,00)
1.351	AAR Corp	Morgan Stanley	(12.516)	(0,00)
(10.472)	Abbott Laboratories	Morgan Stanley	(22.101)	(0,00)
19.815	Abbott Laboratories	JPMorgan Chase Bank	(3.526)	(0,00)
963.129	Abbott Laboratories	Goldman Sachs International	(46.860)	(0,01)
999	Abercrombie & Fitch Co Class A	Morgan Stanley	(2.488)	(0,00)
388.275	ABN AMRO Bank NV	Goldman Sachs International	(41.153)	(0,01)
(34)	Academy Sports & Outdoors Inc	Morgan Stanley	(0)	(0,00)
54.681	Acadia Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(24.822)	(0,00)
3.506	Acadia Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(404)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
202.771	Accenture Plc Class A	Goldman Sachs International	(16.622)	(0,00)
117.191	Accenture Plc Class A	Morgan Stanley	(32.574)	(0,00)
94.063	Accenture Plc Class A	JPMorgan Chase Bank	(5.662)	(0,00)
208.123	Acciona SA	Goldman Sachs International	(27.167)	(0,00)
(1.382)	Accolade Inc	Morgan Stanley	(1.226)	(0,00)
(7.358)	ACM Research Inc Class A	Morgan Stanley	(9.941)	(0,00)
407.489	Acuity Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	(27.687)	(0,00)
349.066	Acuity Brands Inc	Goldman Sachs International	(81.219)	(0,01)
594.234	Acushnet Holdings Corp	Morgan Stanley	(67.441)	(0,01)
(1.302)	ACV Auctions Inc Class A	Morgan Stanley	(545)	(0,00)
(4.898)	AdaptHealth Corp	Morgan Stanley	(2.206)	(0,00)
132.922	Addus HomeCare Corp	Goldman Sachs International	(21.202)	(0,00)
1.194	Adecoagro S.A.	Morgan Stanley	(32)	(0,00)
(2.373)	Adeia Inc	Morgan Stanley	(367)	(0,00)
(850.214)	Adidas AG	Goldman Sachs International	(5.042)	(0,00)
692	Adobe Inc	Morgan Stanley	(3.193)	(0,00)
(467)	ADT Inc	Morgan Stanley	(0)	(0,00)
2.137	Adtalem Global Education Inc	Morgan Stanley	(2.156)	(0,00)
(2.015)	ADTRAN Holdings Inc	Morgan Stanley	(608)	(0,00)
410.037	Advance Auto Parts Inc	Morgan Stanley	(58.557)	(0,01)
(4.969)	Advanced Micro Devices Inc	Morgan Stanley	(47.895)	(0,00)
637	AECOM	Morgan Stanley	(74)	(0,00)
393	AerCap Holdings NV	Morgan Stanley	(44)	(0,00)
39	Affiliated Managers Group Inc	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
33.769	Affirm Holdings Inc	Morgan Stanley	(26.502)	(0,00)
67.329	Aflac Inc	Morgan Stanley	(7.373)	(0,00)
218	AGCO Corp	Morgan Stanley	(226)	(0,00)
45.456	Agilent Technologies Inc	Goldman Sachs International	(10.032)	(0,00)
59.740	Agilent Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(11.484)	(0,00)
(14.689)	Agilon Health Inc	Morgan Stanley	(106)	(0,00)
603	Agilysys Inc	Morgan Stanley	(385)	(0,00)
(2.741)	Agnico Eagle Mines Ltd	Morgan Stanley	(127)	(0,00)
(2.253)	Agree Realty Corp	Morgan Stanley	(990)	(0,00)
(821)	Air Lease Corp	Morgan Stanley	(315)	(0,00)
57.071	Airbnb Inc Class A	Goldman Sachs International	(1.985)	(0,00)
1.569.322	Airbnb Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(118.577)	(0,01)
74.472	Akamai Technologies Inc	Morgan Stanley	(1.689)	(0,00)
(2.512)	Akero Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(2.971)	(0,00)
558	Alamos Gold Inc Class A	Morgan Stanley	(263)	(0,00)
715	Alaska Air Group Inc	Morgan Stanley	(512)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
74.627	Albemarle Corp	JPMorgan Chase Bank	(126)	(0,00)
1.179	Alcoa Corp	Morgan Stanley	(539)	(0,00)
(95.321)	Alcon Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.167)	(0,00)
(80.769)	Alcon Inc	Goldman Sachs International	(2.646)	(0,00)
(30.972)	Alcon Inc	Morgan Stanley	(1.009)	(0,00)
66.092	Alexandria Real Estate Equities Inc	Morgan Stanley	(19.935)	(0,00)
(95.558)	Alibaba Group Holding Ltd	Morgan Stanley	(13.462)	(0,00)
60.470	Align Technology Inc	Goldman Sachs International	(1.774)	(0,00)
160.994	Alimentation Couche-Tard Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.329)	(0,00)
(57.648)	Alkermes Plc	Goldman Sachs International	(3.900)	(0,00)
(57.732)	Alkermes Plc	JPMorgan Chase Bank	(6.712)	(0,00)
1.063.122	Allegion Plc	JPMorgan Chase Bank	(24.222)	(0,00)
(1.676)	Allegion Plc	Morgan Stanley	(5.985)	(0,00)
938	Allegro MicroSystems Inc	Morgan Stanley	(65)	(0,00)
222.123	Allegro.eu SA	Goldman Sachs International	(193)	(0,00)
896.125	Allegro.eu SA	JPMorgan Chase Bank	(35.460)	(0,01)
67.709	Alliant Energy Corp	Morgan Stanley	(7.640)	(0,00)
60.744	Allstate Corp	Morgan Stanley	(15.973)	(0,00)
(2.026)	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	(939)	(0,00)
(367)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(3.810)	(0,00)
257.624	Alnylam Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(18.281)	(0,00)
186.063	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(17.486)	(0,00)
(220)	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Morgan Stanley	(98)	(0,00)
40.487	Alphabet Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(981)	(0,00)
(2.856)	Alphabet Inc Class A	Morgan Stanley	(331)	(0,00)
180.923	Alphabet Inc Class C	JPMorgan Chase Bank	(13.159)	(0,00)
(208)	Altair Engineering Inc Class A	Morgan Stanley	(1.973)	(0,00)
2.678	Alteryx Inc Class A	Morgan Stanley	(167)	(0,00)
570	Altria Group Inc	Morgan Stanley	(163)	(0,00)
(4.425)	A-Mark Precious Metals Inc	Morgan Stanley	(165)	(0,00)
(185.689)	Amazon.com Inc	JPMorgan Chase Bank	(938)	(0,00)
(102.425)	Amazon.com Inc	Morgan Stanley	(4.783)	(0,00)
28	Ambarella Inc	Morgan Stanley	(46)	(0,00)
(77.740)	AMC Entertainment Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(13.110)	(0,00)
(1.180)	Amcor Plc	Morgan Stanley	(1)	(0,00)
(752)	Amdocs Ltd	Morgan Stanley	(64)	(0,00)
67.081	Ameren Corp	Morgan Stanley	(1.291)	(0,00)
(511.036)	American Airlines Group Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.131)	(0,00)
(155.302)	American Airlines Group Inc	Goldman Sachs International	(3.696)	(0,00)
(37.919)	American Airlines Group Inc	Morgan Stanley	(3.699)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
561.351	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	(109.675)	(0,01)
448.861	American Eagle Outfitters Inc	JPMorgan Chase Bank	(16.170)	(0,00)
(1.210)	American Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	(916)	(0,00)
66.060	American Express Co	Morgan Stanley	(17.234)	(0,00)
3.266	American Homes 4 Rent Class A	Morgan Stanley	(151)	(0,00)
748	American States Water Co	Morgan Stanley	(1.404)	(0,00)
(1.020)	American Tower Corp	Morgan Stanley	(2.739)	(0,00)
3.722	American Vanguard Corp	Morgan Stanley	(273)	(0,00)
41.564	Americold Realty Trust Inc	Morgan Stanley	(2.794)	(0,00)
(5)	AMETEK Inc	Morgan Stanley	(0)	(0,00)
267.597	Amgen Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.063)	(0,00)
53.238	Amgen Inc	Goldman Sachs International	(435)	(0,00)
14.964	Amicus Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(4.834)	(0,00)
25.622	Amicus Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(4.293)	(0,00)
8.774	Amicus Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.783)	(0,00)
75.724	AMN Healthcare Services Inc	Goldman Sachs International	(890)	(0,00)
(350)	AMN Healthcare Services Inc	Morgan Stanley	(412)	(0,00)
159.179	Amphenol Corp Class A	Morgan Stanley	(35.040)	(0,00)
188	Amplitude Inc Class A	Morgan Stanley	(51)	(0,00)
10.581	Amplitude Inc Class A	Goldman Sachs International	(612)	(0,00)
35.916	Amplitude Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(1.318)	(0,00)
65.445	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	(29.740)	(0,00)
77.917	Anheuser-Busch InBev SA	Goldman Sachs International	(12.869)	(0,00)
431.353	Anheuser-Busch InBev SA	JPMorgan Chase Bank	(58.075)	(0,01)
68.074	Annaly Capital Management Inc	Morgan Stanley	(8.308)	(0,00)
72.977	ANSYS Inc	Morgan Stanley	(64.078)	(0,01)
(79.252)	Antero Midstream Corp	Morgan Stanley	(4.063)	(0,00)
(311.371)	Antero Resources Corp	JPMorgan Chase Bank	(12.491)	(0,00)
31.274	Apellis Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(19.345)	(0,00)
(5.601)	API Group Corp	Morgan Stanley	(3.304)	(0,00)
79.224	Apogee Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(35.756)	(0,01)
(3.471)	Apollo Global Management Inc	Morgan Stanley	(1.591)	(0,00)
(721)	Apollo Medical Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.062)	(0,00)
(498)	Appfolio Inc Class A	Morgan Stanley	(5.307)	(0,00)
(47.871)	Appfolio Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(1.883)	(0,00)
74.020	Apple Inc	Goldman Sachs International	(1.250)	(0,00)
197.832	Apple Inc	JPMorgan Chase Bank	(17.448)	(0,00)
(458)	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	(532)	(0,00)
3.117	AppLovin Corp Class A	Morgan Stanley	(11.882)	(0,00)
16.570	Aptargroup Inc	Morgan Stanley	(229)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(977)	Aptiv Plc	Morgan Stanley	(1.121)	(0,00)
67.346	Aramark	Morgan Stanley	(4.506)	(0,00)
52.628	Arcellx Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.543)	(0,00)
60.994	Arcellx Inc	Goldman Sachs International	(8.330)	(0,00)
(6.000)	Arch Capital Group Ltd	Morgan Stanley	(2.259)	(0,00)
(239)	Arch Resources Inc	Morgan Stanley	(453)	(0,00)
2.908	Archer Aviation Inc Class A	Morgan Stanley	(841)	(0,00)
378.048	Archer-Daniels-Midland Co	JPMorgan Chase Bank	(4.048)	(0,00)
167	Arcos Dorados Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(18)	(0,00)
(2.340)	Arcus Biosciences Inc	Morgan Stanley	(1.721)	(0,00)
(22.362)	Arcus Biosciences Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.837)	(0,00)
680	Ares Commercial Real Estate Corp	Morgan Stanley	(434)	(0,00)
(1.969)	Ares Management Corp Class A	Morgan Stanley	(4.962)	(0,00)
62.310	Arista Networks Inc	Morgan Stanley	(17.240)	(0,00)
4.660	Arlo Technologies Inc	Morgan Stanley	(18)	(0,00)
(2.531)	ARMOUR Residential REIT Inc	Morgan Stanley	(286)	(0,00)
(1.167)	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(2.533)	(0,00)
(4.741)	ARS Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.595)	(0,00)
63.692	Arthur J Gallagher & Co	Morgan Stanley	(15.197)	(0,00)
(101)	Artisan Partners Asset Management Inc Class A	Morgan Stanley	(0)	(0,00)
(518)	Arvinas Inc	Morgan Stanley	(2.160)	(0,00)
290	Asana Inc Class A	Morgan Stanley	(65)	(0,00)
(100)	Asbury Automotive Group Inc	Morgan Stanley	(121)	(0,00)
42.264	Ashland Inc	Morgan Stanley	(3.224)	(0,00)
55.855	ASML Holding NV	Morgan Stanley	(8.398)	(0,00)
(550)	Aspen Aerogels Inc	Morgan Stanley	(984)	(0,00)
79.039	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	(14.493)	(0,00)
47.858	Assicurazioni Generali	Goldman Sachs International	(772)	(0,00)
65.447	Assurant Inc	Morgan Stanley	(11.096)	(0,00)
139.988	AstraZeneca Plc	JPMorgan Chase Bank	(12.887)	(0,00)
511.419	AstraZeneca Plc	Goldman Sachs International	(30.431)	(0,00)
8.327	AT&T Inc	Goldman Sachs International	(146)	(0,00)
57.543	AT&T Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.230)	(0,00)
310	ATI Inc	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
30.493	Atlassian Corp Class A	Morgan Stanley	(7.405)	(0,00)
64.536	Atmos Energy Corp	Morgan Stanley	(13.706)	(0,00)
(3.867)	Aurora Innovation Inc	Morgan Stanley	(279)	(0,00)
115.289	Autodesk Inc	Morgan Stanley	(14.438)	(0,00)
118.256	Automatic Data Processing Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.616)	(0,00)
(131.947)	Automatic Data Processing Inc	Morgan Stanley	(1.911)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
35.612	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs International	(344)	(0,00)
(151)	AutoNation Inc	Morgan Stanley	(46)	(0,00)
70.566	AutoZone Inc	Morgan Stanley	(1.803)	(0,00)
71.137	Avalonbay Communities Inc	Morgan Stanley	(6.703)	(0,00)
40.629	Avangrid Inc	Morgan Stanley	(5.873)	(0,00)
66.773	Avantor Inc	Morgan Stanley	(11.575)	(0,00)
70.336	Avery Dennison Corp	Morgan Stanley	(8.317)	(0,00)
(911)	Avid Bioservices Inc	Morgan Stanley	(91)	(0,00)
(11.822)	Avidity Biosciences Inc	Morgan Stanley	(4.662)	(0,00)
23.979	AvidXchange Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.196)	(0,00)
(635)	Avista Corp	Morgan Stanley	(361)	(0,00)
(1.055)	Avnet Inc	Morgan Stanley	(896)	(0,00)
228	Axcelis Technologies Inc	Morgan Stanley	(445)	(0,00)
(85.339)	Axis Capital Holdings Ltd	Morgan Stanley	(820)	(0,00)
(90)	Axonics Inc	Morgan Stanley	(257)	(0,00)
(2.343)	Axsome Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(19.342)	(0,00)
34.994	AZEK Co Inc	Morgan Stanley	(12.853)	(0,00)
32.813	Azenta Inc	Morgan Stanley	(15.164)	(0,00)
(270)	AZZ Inc	Morgan Stanley	(943)	(0,00)
1.334.686	B3 SA - Brasil Bolsa Balca	Goldman Sachs International	(12.764)	(0,00)
3.157	Baker Hughes Co	Morgan Stanley	(143)	(0,00)
(729.167)	Baker Hughes Co	Goldman Sachs International	(1.960)	(0,00)
(288.914)	Baker Hughes Co	JPMorgan Chase Bank	(8.643)	(0,00)
65.976	Ball Corp	Morgan Stanley	(11.456)	(0,00)
101.554	Banca Generali SpA	Goldman Sachs International	(7.740)	(0,00)
(80.073)	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	Goldman Sachs International	(3.574)	(0,00)
520.610	Banco BTG Pactual SA	Goldman Sachs International	(4.250)	(0,00)
587.685	Banco Do Brasil SA	Goldman Sachs International	(6.624)	(0,00)
918.750	Banco Santander	Goldman Sachs International	(24.229)	(0,00)
(312.742)	Banco Santander SA	Goldman Sachs International	(14.312)	(0,00)
219	Bancorp Inc	Morgan Stanley	(606)	(0,00)
6.014	Bank of America Corp	Morgan Stanley	(763)	(0,00)
(100.902)	Bank Of Ireland Group Plc	Goldman Sachs International	(4.523)	(0,00)
(12.847)	Bank of New York Mellon Corp	Morgan Stanley	(8.637)	(0,00)
(4.500)	Bank of Nova Scotia	Morgan Stanley	(4.169)	(0,00)
2.948	Bank OZK	Morgan Stanley	(1.647)	(0,00)
(181.030)	Bankinter SA	Goldman Sachs International	(14.728)	(0,00)
(660)	Barrick Gold Corp	Morgan Stanley	(8)	(0,00)
520.915	Bath & Body Works Inc	JPMorgan Chase Bank	(900)	(0,00)
(75.842)	Baxter International Inc	Morgan Stanley	(11.293)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
959.082	Baxter International Inc	Goldman Sachs International	(23.128)	(0,00)
729.267	BB Seguridade Participacoes SA	Goldman Sachs International	(11.616)	(0,00)
2.030	Beacon Roofing Supply Inc	Morgan Stanley	(1.054)	(0,00)
89.833	Beam Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.436)	(0,00)
1.625	Becton Dickinson & Co	Goldman Sachs International	(75)	(0,00)
(703)	Becton Dickinson & Co	Morgan Stanley	(1.709)	(0,00)
(157.649)	BeiGene Ltd	Goldman Sachs International	(13.802)	(0,00)
(62.815)	BeiGene Ltd	JPMorgan Chase Bank	(10.084)	(0,00)
891	BellRing Brands Inc	Morgan Stanley	(206)	(0,00)
63.128	Bentley Systems Inc Class B	Morgan Stanley	(6.637)	(0,00)
(1.221)	Berkshire Hathaway Inc	Morgan Stanley	(124)	(0,00)
256	Berkshire Hills Bancorp Inc	Morgan Stanley	(71)	(0,00)
796.280	Best Buy Co Inc	Morgan Stanley	(60.366)	(0,01)
511.147	Best Buy Co Inc	JPMorgan Chase Bank	(27.881)	(0,00)
(1.134)	Beyond Inc	Morgan Stanley	(2.454)	(0,00)
(172)	BGC Group Inc Class A	Morgan Stanley	(22)	(0,00)
5.552.198	Bid Corp Ltd	Goldman Sachs International	(6.958)	(0,00)
3.575.012	Bid Corp Ltd	JPMorgan Chase Bank	(8.241)	(0,00)
8.946	Bill.com Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.772)	(0,00)
67.156	Biogen Inc	Goldman Sachs International	(9.402)	(0,00)
95.076	Biogen Inc	JPMorgan Chase Bank	(8.032)	(0,00)
(503)	Biogen Inc	Morgan Stanley	(4.264)	(0,00)
(1.238)	Biohaven Ltd	Morgan Stanley	(5.471)	(0,00)
(380)	BioLife Solutions Inc	Morgan Stanley	(322)	(0,00)
40.654	BioMarin Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	(5.434)	(0,00)
41.004	BioMarin Pharmaceutical Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.656)	(0,00)
40.211	BioMarin Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs International	(5.208)	(0,00)
(1.069)	Biomea Fusion Inc	Morgan Stanley	(190)	(0,00)
(43)	Bio-Rad Laboratories Inc Class A	Morgan Stanley	(523)	(0,00)
701.441	Birkenstock Holding Plc	Morgan Stanley	(110.590)	(0,01)
629.851	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Goldman Sachs International	(16.572)	(0,00)
(392.246)	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Morgan Stanley	(23.797)	(0,00)
688.810	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(15.787)	(0,00)
3.453	Black Hills Corp	Morgan Stanley	(2.275)	(0,00)
2.710	BlackLine Inc	Morgan Stanley	(1.486)	(0,00)
60.535	BlackRock Inc	Morgan Stanley	(20.545)	(0,00)
72.718	Blackstone Inc	Morgan Stanley	(16.189)	(0,00)
727	Blackstone Mortgage Trust Inc Class A	Morgan Stanley	(119)	(0,00)
2.385	Blackstone Secured Lending Fund	Morgan Stanley	(2)	(0,00)
(9.311)	Bloom Energy Corp Class A	Morgan Stanley	(6.272)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
1.602	Blue Owl Capital Corp	Morgan Stanley	(164)	(0,00)
33.693	Blue Owl Capital Inc	Morgan Stanley	(6.945)	(0,00)
21.834	Blueprint Medicines Corp	Goldman Sachs International	(11.743)	(0,00)
57.522	Blueprint Medicines Corp	JPMorgan Chase Bank	(27.696)	(0,00)
(416)	Blueprint Medicines Corp	Morgan Stanley	(2.962)	(0,00)
199.663	BNP Paribas SA	Goldman Sachs International	(27.635)	(0,00)
78.406	Boeing Co	Morgan Stanley	(19.715)	(0,00)
43.783	BOK Financial Corp	Morgan Stanley	(6.245)	(0,00)
734.119	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	(145.343)	(0,01)
100.531	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs International	(27.133)	(0,00)
(1.233.775)	Boot Barn Holdings Inc	Morgan Stanley	(47.896)	(0,01)
331.936	BorgWarner Inc	JPMorgan Chase Bank	(17.505)	(0,00)
292.568	BorgWarner Inc	Goldman Sachs International	(21.779)	(0,00)
188	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	(22)	(0,00)
206	Boston Beer Co Inc Class A	Morgan Stanley	(449)	(0,00)
64	Boston Scientific Corp	Morgan Stanley	(6)	(0,00)
9.221	Box Inc Class A	Morgan Stanley	(4.875)	(0,00)
(110.630)	BPER Banca	Goldman Sachs International	(2.333)	(0,00)
474	Brady Corp Class A	Morgan Stanley	(54)	(0,00)
(100)	Brandywine Realty Trust	Morgan Stanley	(11)	(0,00)
(641)	Bridgebio Pharma Inc	Morgan Stanley	(1.044)	(0,00)
39.129	Bright Horizons Family Solutions Inc	Morgan Stanley	(5.999)	(0,00)
1.706	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	(1.069)	(0,00)
4.825	Brightsphere Investment Group Inc	Morgan Stanley	(2.384)	(0,00)
4.576	BrightSpire Capital Inc	Morgan Stanley	(1.033)	(0,00)
(40)	Brink's Co	Morgan Stanley	(10)	(0,00)
7.931	Bristol-Myers Squibb Co	Morgan Stanley	(72)	(0,00)
3.668	Brixmor Property Group Inc	Morgan Stanley	(440)	(0,00)
(283)	Broadridge Financial Solutions Inc	Morgan Stanley	(1.120)	(0,00)
9	Brookfield Corp	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
2.232	Brookfield Infrastructure Corp Class A	Morgan Stanley	(1)	(0,00)
(5.840)	Brookfield Renewable Corp Class A	Morgan Stanley	(33)	(0,00)
240.277	Brookfield Renewable Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(70.193)	(0,01)
191.652	Brookfield Renewable Corp Class A	Goldman Sachs International	(19.691)	(0,00)
70.191	Brown & Brown Inc	Morgan Stanley	(1.672)	(0,00)
(175.071)	Brown-Forman Corp Class B	Morgan Stanley	(2.788)	(0,00)
(151.677)	Brown-Forman Corp Class B	Goldman Sachs International	(1.217)	(0,00)
(337.383)	Brown-Forman Corp Class B	JPMorgan Chase Bank	(6.337)	(0,00)
(236)	BRP Group Inc Class A	Morgan Stanley	(142)	(0,00)
207	Bruker Corp	Morgan Stanley	(6)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
40.289	Brunswick Corp	Morgan Stanley	(10.144)	(0,00)
272.880	Brunswick Corp	JPMorgan Chase Bank	(86.757)	(0,01)
535.998	Bunge Global SA	JPMorgan Chase Bank	(34)	(0,00)
(2.120)	Cabaletta Bio Inc	Morgan Stanley	(2.175)	(0,00)
1.174	Cadence Design Systems Inc	Morgan Stanley	(160)	(0,00)
2.021	Caesars Entertainment Inc	Morgan Stanley	(799)	(0,00)
(2.948)	Cal-Maine Foods Inc	Morgan Stanley	(5.140)	(0,00)
845.313	Campbell Soup Co	Morgan Stanley	(32.902)	(0,01)
199.435	Campbell Soup Co	JPMorgan Chase Bank	(16.107)	(0,00)
991	Canada Goose Holdings Inc	Morgan Stanley	(329)	(0,00)
1.441.725	Canadian National Railway Co	JPMorgan Chase Bank	(39.586)	(0,01)
(1.180)	Canadian National Railway Co	Morgan Stanley	(958)	(0,00)
(35.196)	Canadian Natural Resources	Morgan Stanley	(613)	(0,00)
668.590	Canadian Natural Resources Ltd	JPMorgan Chase Bank	(357)	(0,00)
10.380	Canadian Natural Resources Ltd	Goldman Sachs International	(132)	(0,00)
2.045	Canadian Natural Resources Ltd	Morgan Stanley	(1.231)	(0,00)
530.871	Canadian Pacific Kansas City Ltd	Goldman Sachs International	(9.923)	(0,00)
1.378.234	Canadian Pacific Kansas City Ltd	JPMorgan Chase Bank	(29.999)	(0,00)
(232)	Canadian Solar Inc	Morgan Stanley	(105)	(0,00)
1.934	Capitol Federal Financial Inc	Morgan Stanley	(428)	(0,00)
41.999	Capri Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1.086)	(0,00)
466.855	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs International	(308)	(0,00)
12.045	CareTrust REIT Inc	Morgan Stanley	(5.582)	(0,00)
(52.024)	Cargurus Inc	JPMorgan Chase Bank	(632)	(0,00)
67.891	Carlisle Cos Inc	Morgan Stanley	(16.195)	(0,00)
90.485	Carlyle Group Inc	Morgan Stanley	(16.678)	(0,00)
(2.293)	CarMax Inc	Morgan Stanley	(1.868)	(0,00)
(569.107)	Carnival Corp	JPMorgan Chase Bank	(23.333)	(0,00)
51.757	Carnival Corp	Morgan Stanley	(35.680)	(0,01)
(12)	Carpenter Technology Corp	Morgan Stanley	(0)	(0,00)
197	Carriage Services Inc	Morgan Stanley	(25)	(0,00)
295.425	Carrier Global Corp	Goldman Sachs International	(20.074)	(0,00)
152.765	Carrier Global Corp	JPMorgan Chase Bank	(16.303)	(0,00)
70.705	Carrier Global Corp	Morgan Stanley	(10.429)	(0,00)
1.400	Carter's Inc	Morgan Stanley	(591)	(0,00)
42.222	Casey's General Stores Inc	Morgan Stanley	(728)	(0,00)
309.070	Catalent Inc	Goldman Sachs International	(33.759)	(0,01)
81.061	Catalent Inc	Morgan Stanley	(2.055)	(0,00)
(200)	Catalyst Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(471)	(0,00)
394.843	Caterpillar Inc	JPMorgan Chase Bank	(79.576)	(0,01)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(104.811)	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	(498)	(0,00)
(100)	Cathay General Bancorp	Morgan Stanley	(2)	(0,00)
64.687	Cboe Global Markets Inc	Morgan Stanley	(9.356)	(0,00)
83.152	CDW Corp	Morgan Stanley	(13.744)	(0,00)
109.565	CDW Corp	JPMorgan Chase Bank	(9.479)	(0,00)
94.530	CDW Corp	Goldman Sachs International	(9.350)	(0,00)
61.466	Celanese Corp	Morgan Stanley	(30.574)	(0,00)
1.110	Celestica Inc	Morgan Stanley	(304)	(0,00)
(2.326)	Celldex Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(3.010)	(0,00)
742	Cellebrite DI Ltd	Morgan Stanley	(11)	(0,00)
(547)	Celsius Holdings Inc	Morgan Stanley	(2.290)	(0,00)
(41.361)	Celsius Holdings Inc	Goldman Sachs International	(2.612)	(0,00)
948.339	Cemig Cia Energetica DE Minas Gerais	Goldman Sachs International	(8.786)	(0,00)
(706.772)	Cenovus Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	(72.373)	(0,01)
(201.412)	Cenovus Energy Inc	Morgan Stanley	(2.425)	(0,00)
(12.251)	Centene Corp	Morgan Stanley	(18.191)	(0,00)
(1.064)	CenterPoint Energy Inc	Morgan Stanley	(41)	(0,00)
(4.338)	Century Aluminum Co	Morgan Stanley	(1.516)	(0,00)
(93.209)	Ceridian HCM Holding Inc	Goldman Sachs International	(839)	(0,00)
(26.013)	Ceridian HCM Holding Inc	JPMorgan Chase Bank	(490)	(0,00)
(24.103)	Ceridian HCM Holding Inc	Morgan Stanley	(350)	(0,00)
33.681	Certara Inc	Morgan Stanley	(14.275)	(0,00)
100	CEVA Inc	Morgan Stanley	(81)	(0,00)
3.561.546	CEZ AS	Goldman Sachs International	(3.615)	(0,00)
(1.953)	CF Industries Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.365)	(0,00)
433	CH Robinson Worldwide Inc	Morgan Stanley	(191)	(0,00)
236	ChampionX Corp	Morgan Stanley	(54)	(0,00)
(509)	Chart Industries Inc	Morgan Stanley	(2.047)	(0,00)
(221)	Charter Communications Inc Class A	Morgan Stanley	(762)	(0,00)
(732)	Check Point Software Technologies Ltd	Morgan Stanley	(597)	(0,00)
136	Cheesecake Factory Inc	Morgan Stanley	(20)	(0,00)
(501.550)	Cheniere Energy Inc	Morgan Stanley	(14.822)	(0,00)
(618.980)	Cheniere Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	(13.115)	(0,00)
(1.578)	Chesapeake Energy Corp	Morgan Stanley	(1.111)	(0,00)
(566.667)	Chevron Corp	Goldman Sachs International	(10.327)	(0,00)
(570.438)	Chevron Corp	Morgan Stanley	(11.282)	(0,00)
(8.074)	Chewy Inc Class A	Morgan Stanley	(855)	(0,00)
(92.347)	Choice Hotels International Inc	Morgan Stanley	(5.315)	(0,00)
(237.971)	Chord Energy Corp	Goldman Sachs International	(3.344)	(0,00)
63.322	Chubb Ltd	Morgan Stanley	(37.040)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
8.642.319	Chugai Pharmaceutical Co	Goldman Sachs International	(14.468)	(0,00)
64.327	Church & Dwight Co Inc	Morgan Stanley	(22.242)	(0,00)
484.461	Cia de Transmissao de Energia	Goldman Sachs International	(12.628)	(0,00)
(1.495.093)	Cia Paranaense De Energia	Goldman Sachs International	(29.537)	(0,00)
89.171	Cie Financiere Richemont SA Class A	JPMorgan Chase Bank	(12.122)	(0,00)
229.724	Cie Financiere Richemont SA Class A	Goldman Sachs International	(14.186)	(0,00)
(153.601)	Ciena Corp	Morgan Stanley	(2.550)	(0,00)
(792)	Cigna Corp	Morgan Stanley	(2.160)	(0,00)
12.800	CinCor Pharma Inc	Morgan Stanley	(19.968)	(0,00)
939	Cinemark Holdings Inc	Morgan Stanley	(210)	(0,00)
(337)	Cisco Systems Inc	Morgan Stanley	(123)	(0,00)
(7.631)	Citigroup Inc	Morgan Stanley	(7.327)	(0,00)
20.282	Clarivate Plc	Morgan Stanley	(22.474)	(0,00)
42.555	Clean Harbors Inc	Morgan Stanley	(3.772)	(0,00)
(22.603)	Cleanspark Inc	Morgan Stanley	(2.709)	(0,00)
9.202	Clear Secure Inc Class A	Morgan Stanley	(10.463)	(0,00)
(2.437)	Clearfield Inc	Morgan Stanley	(1.238)	(0,00)
84.009	Clorox Co	Goldman Sachs International	(237)	(0,00)
21.285	Cloudflare Inc Class A	Morgan Stanley	(7.300)	(0,00)
9.289	Cloudflare Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(5.024)	(0,00)
69.466	CMS Energy Corp	Morgan Stanley	(5.467)	(0,00)
38.740	CNH Industrial NV	Morgan Stanley	(5.868)	(0,00)
(7.099)	CNX Resources Corp	JPMorgan Chase Bank	(335)	(0,00)
298.871	Coca-Cola Co	Goldman Sachs International	(11.344)	(0,00)
268.308	Coca-Cola Co	JPMorgan Chase Bank	(11.957)	(0,00)
(7.476)	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Morgan Stanley	(12.661)	(0,00)
5.391	Coeur Mining Inc	Morgan Stanley	(1.461)	(0,00)
(9.961)	Cogent Biosciences Inc	Morgan Stanley	(6.520)	(0,00)
(380)	Cogent Communications Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.366)	(0,00)
73.329	Cognex Corp	Morgan Stanley	(8.151)	(0,00)
37.737	Cognizant Technology Solutions Corp Class A	Morgan Stanley	(2.079)	(0,00)
28.664	Coherent Corp	Morgan Stanley	(5.284)	(0,00)
522.955	Colgate-Palmolive Co	Goldman Sachs International	(15.264)	(0,00)
93.225	Colgate-Palmolive Co	JPMorgan Chase Bank	(2.014)	(0,00)
(2.604)	Colgate-Palmolive Co	Morgan Stanley	(2.216)	(0,00)
38.601	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	(4.831)	(0,00)
2.505	Comcast Corp Class A	Morgan Stanley	(1.563)	(0,00)
85.557	Comcast Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(6.056)	(0,00)
37.409	Commerce Bancshares Inc	Morgan Stanley	(8.764)	(0,00)
53.798	Commerzbank AG	Goldman Sachs International	(829)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
1.379	Community Health Systems Inc	Morgan Stanley	(99)	(0,00)
272	Community Healthcare Trust Inc	Morgan Stanley	(117)	(0,00)
(3.577)	Compass Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(64)	(0,00)
2.284	Compass Minerals International Inc	Morgan Stanley	(2.087)	(0,00)
(10.964)	Comstock Resources Inc	Morgan Stanley	(712)	(0,00)
48.115	Conagra Brands Inc	Morgan Stanley	(7.946)	(0,00)
(28.742)	Confluent Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(5.155)	(0,00)
1.754	Consensus Cloud Solutions Inc	Morgan Stanley	(1.852)	(0,00)
207.689	CONSOL Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.902)	(0,00)
(121)	CONSOL Energy Inc	Morgan Stanley	(7)	(0,00)
(1.150)	Consolidated Edison Inc	Morgan Stanley	(1.190)	(0,00)
(373.282)	Constellation Brands Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(27.565)	(0,00)
(3.123.690)	Constellation Brands Inc Class A	Morgan Stanley	(143.687)	(0,01)
64.632	Constellation Energy Corp	Morgan Stanley	(7.858)	(0,00)
(239)	Constellium SE	Morgan Stanley	(47)	(0,00)
236	Construction Partners Inc Class A	Morgan Stanley	(127)	(0,00)
(4.300)	Contra Abiomed Inc	Morgan Stanley	(3.139)	(0,00)
(48.286)	Cooper Cos Inc	Goldman Sachs International	(1.106)	(0,00)
26.346	Copart Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.337)	(0,00)
55.220	Copart Inc	Morgan Stanley	(13.228)	(0,00)
34.136	Core & Main Inc Class A	Morgan Stanley	(14.614)	(0,00)
(1.161)	CoreCivic Inc	Morgan Stanley	(235)	(0,00)
31.583	Corning Inc	Morgan Stanley	(23.420)	(0,00)
(2.366)	Costamare Inc	Morgan Stanley	(551)	(0,00)
65.550	CoStar Group Inc	Morgan Stanley	(10.951)	(0,00)
(526.103)	Coterra Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	(15.474)	(0,00)
(6.505)	Coterra Energy Inc	Morgan Stanley	(144)	(0,00)
(32.533)	Coty Inc	Morgan Stanley	(978)	(0,00)
218.734	Coty Inc Class A	Goldman Sachs International	(12.087)	(0,00)
34.916	Coty Inc Class A	Morgan Stanley	(8.092)	(0,00)
159.972	Coty Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(7.388)	(0,00)
(53.442)	Coupang Inc	JPMorgan Chase Bank	(869)	(0,00)
7.635	Coursera Inc	Morgan Stanley	(4.256)	(0,00)
672.126	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Morgan Stanley	(39.222)	(0,01)
41.769	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	(8.213)	(0,00)
274.199	Credit Agricole SA	Goldman Sachs International	(34.260)	(0,01)
(603)	Crescent Energy Co Class A	Morgan Stanley	(34)	(0,00)
7.626	Crescent Point Energy Corp	Morgan Stanley	(1.556)	(0,00)
(3.277)	Crinetics Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(700)	(0,00)
267.829	CRISPR Therapeutics AG	JPMorgan Chase Bank	(40.787)	(0,01)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(797)	CRISPR Therapeutics AG	Morgan Stanley	(255)	(0,00)
139	Crocs Inc	Morgan Stanley	(476)	(0,00)
56.104	Cross Country Healthcare Inc	Goldman Sachs International	(5.418)	(0,00)
10.971	Crowdstrike Holdings Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(4.542)	(0,00)
7	Crowdstrike Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
57.712	Crown Castle Inc	Morgan Stanley	(16.540)	(0,00)
77.148	Crown Holdings Inc	Morgan Stanley	(4.742)	(0,00)
140.222	CSL Ltd	Goldman Sachs International	(8.793)	(0,00)
(8.083)	CSX Corp	Morgan Stanley	(1.401)	(0,00)
(202)	CTS Corp	Morgan Stanley	(381)	(0,00)
41.751	CubeSmart	Morgan Stanley	(6.910)	(0,00)
(220)	Cullinan Oncology Inc	Morgan Stanley	(271)	(0,00)
626.729	Cummins Inc	JPMorgan Chase Bank	(38.882)	(0,01)
(946)	Cummins Inc	Morgan Stanley	(1.054)	(0,00)
586.956	CVS Health Corp	Goldman Sachs International	(26.121)	(0,00)
(1.323)	Cymabay Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(1.795)	(0,00)
(604)	Cytokinetics Inc	Morgan Stanley	(28.559)	(0,00)
122.829	Danaher Corp	Morgan Stanley	(13.762)	(0,00)
(298)	Darden Restaurants Inc	Morgan Stanley	(417)	(0,00)
76.195	Darling Ingredients Inc	Morgan Stanley	(12.498)	(0,00)
48.613	Datadog Inc Class A	Morgan Stanley	(9.410)	(0,00)
(100)	Day One Biopharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(45)	(0,00)
954.256	Deckers Outdoor Corp	JPMorgan Chase Bank	(28.868)	(0,00)
(567)	Dell Technologies Inc Class C	Morgan Stanley	(930)	(0,00)
(100.396)	Delta Air Lines Inc	Goldman Sachs International	(869)	(0,00)
(80.420)	Delta Air Lines Inc	Morgan Stanley	(4.501)	(0,00)
127.444	Denali Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.924)	(0,00)
342.164	DENTSPLY SIRONA Inc	Goldman Sachs International	(59.391)	(0,01)
72.527	DENTSPLY SIRONA Inc	Morgan Stanley	(9.936)	(0,00)
812	Deutsche Bank AG	Morgan Stanley	(72)	(0,00)
(127.670)	Devon Energy Corp	Morgan Stanley	(928)	(0,00)
167	DHT Holdings Inc	Morgan Stanley	(12)	(0,00)
619.646	Diageo Plc	JPMorgan Chase Bank	(13.820)	(0,00)
332.880	Diageo Plc	Goldman Sachs International	(11.411)	(0,00)
6.402	Diamond Offshore Drilling Inc	Morgan Stanley	(742)	(0,00)
31.126	Diamondback Energy Inc	Morgan Stanley	(1.077)	(0,00)
(2.176)	DiamondRock Hospitality Co	Morgan Stanley	(91)	(0,00)
(1.370)	Dick's Sporting Goods Inc	Morgan Stanley	(750)	(0,00)
58.020	Digital Realty Trust Inc	Morgan Stanley	(13.273)	(0,00)
837.747	Dino Polska SA	JPMorgan Chase Bank	(1.709)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(159)	Discover Financial Services	Morgan Stanley	(29)	(0,00)
(1.826)	DISH Network Corp Class A	Morgan Stanley	(47.675)	(0,00)
4.465.000	DISH Network Corp	Nomura	(309.246)	(0,02)
(242)	Distribution Solutions Group Inc	Morgan Stanley	(43)	(0,00)
3.012.279	DNB Bank ASA	Goldman Sachs International	(14.616)	(0,00)
3.000	DocuSign Inc	Morgan Stanley	(2.560)	(0,00)
(1.945)	Dolby Laboratories Inc Class A	Morgan Stanley	(137)	(0,00)
59.647	Dollar General Corp	Morgan Stanley	(18.624)	(0,00)
428.295	Dollar General Corp	JPMorgan Chase Bank	(13.531)	(0,00)
64.556	Dollar Tree Inc	Morgan Stanley	(23.574)	(0,00)
65.637	Dominion Energy Inc	Morgan Stanley	(7.779)	(0,00)
827.832	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	(100.725)	(0,01)
677	Donaldson Co Inc	Morgan Stanley	(224)	(0,00)
364.614	DoorDash Inc Class A	Morgan Stanley	(58.859)	(0,01)
33.138	DoubleVerify Holdings Inc	Morgan Stanley	(13.702)	(0,00)
71.707	Dover Corp	Morgan Stanley	(8.977)	(0,00)
71.625	Dow Inc	Morgan Stanley	(6.873)	(0,00)
30.566	Doximity Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(4.640)	(0,00)
36.595	Doximity Inc Class A	Goldman Sachs International	(4.614)	(0,00)
(472.403)	DR Horton Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.610)	(0,00)
59.681	DR Horton Inc	Morgan Stanley	(29.548)	(0,00)
(489.313)	DR Horton Inc	Goldman Sachs International	(138)	(0,00)
53.891	DraftKings Inc Class A	Morgan Stanley	(12.691)	(0,00)
27	Dream Finders Homes Inc Class A	Morgan Stanley	(16)	(0,00)
35.611	Driven Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	(7.510)	(0,00)
473.783	DT Midstream Inc	Goldman Sachs International	(16.873)	(0,00)
38.156	DT Midstream Inc	Morgan Stanley	(2.302)	(0,00)
10.018	DTE Energy Co	Morgan Stanley	(1.617)	(0,00)
(1.173)	Duckhorn Portfolio Inc	Morgan Stanley	(170)	(0,00)
66.066	Duke Energy Corp	Morgan Stanley	(11.225)	(0,00)
1.033	Duolingo Inc	Morgan Stanley	(10.569)	(0,00)
(2.001)	DuPont de Nemours Inc	Morgan Stanley	(5.262)	(0,00)
(4.280)	DXC Technology Co	Morgan Stanley	(1.400)	(0,00)
(10.637)	Dynavax Technologies Corp	Morgan Stanley	(6.355)	(0,00)
(2.437)	Dyne Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(3.351)	(0,00)
100	Eagle Bancorp Inc	Morgan Stanley	(73)	(0,00)
(307)	Eastman Chemical Co	Morgan Stanley	(10)	(0,00)
68.803	Eaton Corp Plc	Morgan Stanley	(10.578)	(0,00)
48.978	eBay Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.356)	(0,00)
(9.336)	eBay Inc	Morgan Stanley	(3.737)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
150.241	eBay Inc	Goldman Sachs International	(5.620)	(0,00)
(9)	EchoStar Corp Class A	Morgan Stanley	(24)	(0,00)
280.114	Edgewell Personal Care Co	JPMorgan Chase Bank	(11.482)	(0,00)
324.762	Edgewell Personal Care Co	Goldman Sachs International	(14.436)	(0,00)
38.853	Edwards Lifesciences Corp	JPMorgan Chase Bank	(4.792)	(0,00)
204.542	Edwards Lifesciences Corp	Goldman Sachs International	(10.708)	(0,00)
(1.923)	Edwards Lifesciences Corp	Morgan Stanley	(2.926)	(0,00)
106.563	eFFECTOR Therapeutics	Goldman Sachs International	(9.425)	(0,00)
39.179	Elanco Animal Health Inc	Morgan Stanley	(10.221)	(0,00)
17.079	Electronic Arts Inc	JPMorgan Chase Bank	(33)	(0,00)
85.276	Electronic Arts Inc	Morgan Stanley	(5.333)	(0,00)
21.620	Electronic Arts Inc	Goldman Sachs International	(2.961)	(0,00)
31.128	Element Solutions Inc	Morgan Stanley	(10.069)	(0,00)
506.881	Elevance Health Inc	Goldman Sachs International	(2.265)	(0,00)
1.594	elf Beauty Inc	Morgan Stanley	(3.089)	(0,00)
(556.553)	Eli Lilly & Co	JPMorgan Chase Bank	(1.984)	(0,00)
260.098	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs International	(4.767)	(0,00)
278.738	Embecta Corp	Goldman Sachs International	(19.133)	(0,00)
(582)	Emerson Electric Co	Morgan Stanley	(681)	(0,00)
14.580	Empire State Realty Trust Inc Class A	Morgan Stanley	(2.224)	(0,00)
1.937	Enact Holdings Inc	Morgan Stanley	(476)	(0,00)
(177.422)	Enagas SA	Goldman Sachs International	(9.464)	(0,00)
97.667	Encompass Health Corp	Goldman Sachs International	(3.805)	(0,00)
(6.114)	Endeavor Group Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(2.000)	(0,00)
718.387	Energisa SA	Goldman Sachs International	(4.395)	(0,00)
(10.198)	Energy Fuels Inc	Morgan Stanley	(814)	(0,00)
7.320	Enerplus Corp	Morgan Stanley	(643)	(0,00)
1.778	Enfusion Inc	Morgan Stanley	(219)	(0,00)
(288)	EngageSmart Inc	Morgan Stanley	(6)	(0,00)
943.380	Engie Brasil Energia SA	Goldman Sachs International	(14.727)	(0,00)
(1.000.000)	ENI SpA	BNP Paribas	(107.432)	(0,01)
(845)	Ensign Group Inc	Morgan Stanley	(360)	(0,00)
112.368	Entegris Inc	Morgan Stanley	(32.974)	(0,00)
939	Envista Holdings Corp	Morgan Stanley	(148)	(0,00)
(858.254)	EOG Resources Inc	JPMorgan Chase Bank	(27.120)	(0,00)
1.899	EOG Resources Inc	Morgan Stanley	(6.305)	(0,00)
647	EPR Properties	Morgan Stanley	(155)	(0,00)
(10.325)	EQT Corp	Morgan Stanley	(3.915)	(0,00)
(307.610)	EQT Corp	JPMorgan Chase Bank	(26.252)	(0,00)
937.214	Equatorial Energia SA	Goldman Sachs International	(12.996)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(11.683)	Equifax Inc	JPMorgan Chase Bank	(108)	(0,00)
60.271	Equifax Inc	Morgan Stanley	(26.426)	(0,00)
65.409	Equinix Inc	Morgan Stanley	(11.033)	(0,00)
118	Equinox Gold Corp	Morgan Stanley	(21)	(0,00)
216	Equitable Holdings Inc	Morgan Stanley	(21)	(0,00)
(4.393)	Equitrans Midstream Corp	Morgan Stanley	(151)	(0,00)
65.405	Equity LifeStyle Properties Inc	Morgan Stanley	(8.725)	(0,00)
747	Equity Residential	Morgan Stanley	(231)	(0,00)
189	Essential Properties Realty Trust Inc	Morgan Stanley	(13)	(0,00)
(100)	Establishment Labs Holdings Inc	Morgan Stanley	(221)	(0,00)
(78.507)	Estee Lauder Cos Inc Class A	Goldman Sachs International	(653)	(0,00)
414.792	Etsy Inc	JPMorgan Chase Bank	(6.271)	(0,00)
36.308	Etsy Inc	Goldman Sachs International	(2.276)	(0,00)
38.144	Evercore Inc Class A	Morgan Stanley	(10.831)	(0,00)
(127.902)	Everest Group Ltd	Morgan Stanley	(15.429)	(0,00)
(9.070)	Eversource Energy	Morgan Stanley	(3.815)	(0,00)
(1.821)	Evolent Health Inc Class A	Morgan Stanley	(3.927)	(0,00)
221.893	Evraz Plc	Morgan Stanley	(227.224)	(0,02)
114.551	Exelixis Inc	Goldman Sachs International	(12.422)	(0,00)
38.754	Exelixis Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.456)	(0,00)
(9.364)	Exelon Corp	Morgan Stanley	(6.912)	(0,00)
(470)	eXp World Holdings Inc	Morgan Stanley	(198)	(0,00)
4.204	Expedia Group Inc	Goldman Sachs International	(169)	(0,00)
104.611	Expedia Group Inc	JPMorgan Chase Bank	(14.513)	(0,00)
(4.096)	Expeditors International of Washington Inc	Morgan Stanley	(1.739)	(0,00)
74.196	Expeditors Intl Wash Inc	Morgan Stanley	(4.679)	(0,00)
66.005	Extra Space Storage Inc	Morgan Stanley	(25.450)	(0,00)
7.566	Extreme Networks Inc	Morgan Stanley	(1.960)	(0,00)
236	EZCORP Inc Class A	Morgan Stanley	(57)	(0,00)
7.983	F5 Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.450)	(0,00)
82.021	F5 Inc	Morgan Stanley	(13.583)	(0,00)
(92)	Fabrinet	Morgan Stanley	(13)	(0,00)
71.527	FactSet Research Systems Inc	Morgan Stanley	(7.021)	(0,00)
59.441	Fair Isaac Corp	Morgan Stanley	(20.806)	(0,00)
86	FB Financial Corp	Morgan Stanley	(41)	(0,00)
1.680	Federal Realty Investment Trust	Morgan Stanley	(1.605)	(0,00)
16.813	Federated Hermes Inc	Morgan Stanley	(1.627)	(0,00)
230.860	FedEx Corp	JPMorgan Chase Bank	(4.732)	(0,00)
63.476	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	(11.166)	(0,00)
167.511	Finecobank SpA	Goldman Sachs International	(20.806)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(100)	First Advantage Corp	Morgan Stanley	(38)	(0,00)
(1.149)	First American Financial Corp	Morgan Stanley	(719)	(0,00)
528	First BanCorp	Morgan Stanley	(91)	(0,00)
(125.659)	First Citizens BancShares Inc Class A	Morgan Stanley	(2.295)	(0,00)
(991)	First Commonwealth Financial Corp	Morgan Stanley	(80)	(0,00)
2.000	First Financial Bancorp	Morgan Stanley	(235)	(0,00)
73.247	First Solar Inc	Morgan Stanley	(9.139)	(0,00)
(212)	First Watch Restaurant Group Inc	Morgan Stanley	(69)	(0,00)
(4.058)	FirstEnergy Corp	Morgan Stanley	(1.425)	(0,00)
5.555.973	FirstRand Ltd	JPMorgan Chase Bank	(28.776)	(0,00)
172.504	Fiserv Inc	Morgan Stanley	(17.082)	(0,00)
34.432	Five Below Inc	Morgan Stanley	(22.652)	(0,00)
12.690	Fiverr International Ltd	JPMorgan Chase Bank	(1.417)	(0,00)
42.421	Fiverr International Ltd	Goldman Sachs International	(7.922)	(0,00)
131	Fiverr International Ltd	Morgan Stanley	(81)	(0,00)
101.894	Fleetcor Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(21.170)	(0,00)
1.817	FLEX LNG Ltd	Morgan Stanley	(1.453)	(0,00)
(7.141)	Flex Ltd	Morgan Stanley	(3.615)	(0,00)
62.578	Flight Centre Travel Group	JPMorgan Chase Bank	(4.553)	(0,00)
21.925	Flight Centre Travel Group	Goldman Sachs International	(668)	(0,00)
271.327	Floor & Decor Holdings Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(84.455)	(0,01)
726.095	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(226.047)	(0,02)
840	Flowserve Corp	Morgan Stanley	(230)	(0,00)
2.900	Fluor Corp	Morgan Stanley	(872)	(0,00)
(258.359)	Flutter Entertainment Plc	JPMorgan Chase Bank	(11.072)	(0,00)
2.852	Flywire Corp	Morgan Stanley	(933)	(0,00)
34.233	FNB Corp	Morgan Stanley	(11.458)	(0,00)
263.172	Ford Motor Co	JPMorgan Chase Bank	(14.776)	(0,00)
2.488.478	Ford Motor Co	Goldman Sachs International	(529.924)	(0,04)
(2.291)	Ford Motor Co	Morgan Stanley	(326)	(0,00)
(921)	Fortis Inc	Morgan Stanley	(170)	(0,00)
73.720	Fortive Corp	Morgan Stanley	(7.900)	(0,00)
267.288	Fortrea Holdings Inc	Goldman Sachs International	(24.710)	(0,00)
(4.452)	Fortrea Holdings Inc	Morgan Stanley	(7.848)	(0,00)
39	Fortuna Silver Mines Inc	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
27.460	Fortune Brands Innovations Inc	Morgan Stanley	(3.273)	(0,00)
2.625	Forward Air Corp	Morgan Stanley	(4.466)	(0,00)
(13.588)	Fox Corp Class A	Morgan Stanley	(58)	(0,00)
(2.241)	Fox Corp Class A	Goldman Sachs International	(4)	(0,00)
(57.589)	Fox Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(221)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(128.055)	Fox Corp Class B	Morgan Stanley	(4.026)	(0,00)
151	Franco-Nevada Corp	Morgan Stanley	(164)	(0,00)
67.574	Franklin Resources Inc	Morgan Stanley	(17.726)	(0,00)
(161.042)	Freeport-McMoRan Inc	Morgan Stanley	(15.340)	(0,00)
38.057	Freshpet Inc	Morgan Stanley	(14.171)	(0,00)
5.486	Frontdoor Inc	Morgan Stanley	(5.397)	(0,00)
25.885	Frontier Communications Parent Inc	Morgan Stanley	(23.927)	(0,00)
31.533	Frontier Investment Corp	Goldman Sachs International	(1.133)	(0,00)
598	Frontline Plc	Morgan Stanley	(394)	(0,00)
34.090	FTI Consulting Inc	Morgan Stanley	(4.333)	(0,00)
2.361	FuboTV Inc	Morgan Stanley	(302)	(0,00)
(4.483)	Gaming and Leisure Properties Inc	Morgan Stanley	(2.348)	(0,00)
(217.588)	Gap Inc	Goldman Sachs International	(10.344)	(0,00)
444	Gap Inc	Morgan Stanley	(81)	(0,00)
63.298	Garmin Ltd	Morgan Stanley	(15.649)	(0,00)
59.470	Gartner Inc	Morgan Stanley	(18.399)	(0,00)
(1.251)	GE HealthCare Technologies Inc	Morgan Stanley	(286)	(0,00)
1.419	Gen Digital Inc	Morgan Stanley	(232)	(0,00)
(8.855)	Genco Shipping & Trading Ltd	Morgan Stanley	(6.114)	(0,00)
1.126.487	General Mills Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.048)	(0,00)
997.446	General Mills Inc	Morgan Stanley	(9.167)	(0,00)
530.041	General Mills Inc	Goldman Sachs International	(3.989)	(0,00)
(11.768)	General Motors Co	Morgan Stanley	(927)	(0,00)
2.144.987	Genmab A/S	Goldman Sachs International	(9.954)	(0,00)
2.844.336	Genmab A/S	JPMorgan Chase Bank	(1.439)	(0,00)
372	Genuine Parts Co	Morgan Stanley	(30)	(0,00)
1.136	Genworth Financial Inc Class A	Morgan Stanley	(54)	(0,00)
(5.253)	GEO Group Inc	Morgan Stanley	(784)	(0,00)
(1.319)	GFL Environmental Inc	Morgan Stanley	(1.758)	(0,00)
693.826	Gildan Activewear Inc	Morgan Stanley	(47.209)	(0,01)
570.561	Gilead Sciences Inc	Goldman Sachs International	(30.954)	(0,00)
18.000	Ginkgo Bioworks Holdings Inc	Morgan Stanley	(2.284)	(0,00)
6.500	Gitlab Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(130)	(0,00)
33.717	Gitlab Inc Class A	Goldman Sachs International	(1.104)	(0,00)
108	Global Net Lease Inc	Morgan Stanley	(11)	(0,00)
342	Global Payments Inc	Morgan Stanley	(60)	(0,00)
2.397	Global Payments Inc	JPMorgan Chase Bank	(375)	(0,00)
58.623	Global Payments Inc	Goldman Sachs International	(10.173)	(0,00)
1.946	Global-e Online Ltd	Goldman Sachs International	(24)	(0,00)
60.184	Global-e Online Ltd	JPMorgan Chase Bank	(3.903)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
42.855	GlobalFoundries Inc	Morgan Stanley	(2.978)	(0,00)
36.380	Globant SA	Morgan Stanley	(9.120)	(0,00)
7.893	Globe Life Inc	Morgan Stanley	(1.124)	(0,00)
81.800	GoDaddy Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(12.214)	(0,00)
153.382	GoDaddy Inc Class A	Goldman Sachs International	(36.537)	(0,00)
(497)	Gogo Inc	Morgan Stanley	(233)	(0,00)
98	Golar LNG Ltd	Morgan Stanley	(10)	(0,00)
471	Golden Entertainment Inc	Morgan Stanley	(290)	(0,00)
(2.263)	Golden Ocean Group Ltd	Morgan Stanley	(1.149)	(0,00)
6.767	Golub Capital BDC Inc	Morgan Stanley	(373)	(0,00)
(3)	GoodRx Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(0)	(0,00)
588	Goodyear Tire & Rubber Co	Morgan Stanley	(166)	(0,00)
180	Goosehead Insurance Inc Class A	Morgan Stanley	(138)	(0,00)
1.525	Grand Canyon Education Inc	Morgan Stanley	(13.229)	(0,00)
1.855	Granite Ridge Resources Inc	Morgan Stanley	(246)	(0,00)
28.993	Graphic Packaging Holding Co	Morgan Stanley	(5.787)	(0,00)
(244)	Gray Television Inc	Morgan Stanley	(66)	(0,00)
100	Green Dot Corp Class A	Morgan Stanley	(17)	(0,00)
2.658	Green Plains Inc	Morgan Stanley	(1.529)	(0,00)
(1.155)	Grid Dynamics Holdings Inc	Morgan Stanley	(51)	(0,00)
42.910	Grifols SA	Goldman Sachs International	(3.999)	(0,00)
795	Grocery Outlet Holding Corp	Morgan Stanley	(20)	(0,00)
2.122.273	Growthpoint Properties Ltd	JPMorgan Chase Bank	(7.177)	(0,00)
1.241.673	Growthpoint Properties Ltd	Goldman Sachs International	(6.988)	(0,00)
38.341	GSK Plc	JPMorgan Chase Bank	(2.329)	(0,00)
140.554	GSK Plc	Goldman Sachs International	(11.793)	(0,00)
37.275	GSK Plc	Morgan Stanley	(3.035)	(0,00)
282	Guess? Inc	Morgan Stanley	(140)	(0,00)
16.797	Guidewire Software Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.811)	(0,00)
25.917	Guidewire Software Inc	Goldman Sachs International	(6.603)	(0,00)
41.553	GXO Logistics Inc	Morgan Stanley	(4.349)	(0,00)
152.301	H Lundbeck A/S	Morgan Stanley	(304)	(0,00)
(103.603)	Hain Celestial Group Inc	Morgan Stanley	(7.495)	(0,00)
(239.602)	Haleon Plc	Goldman Sachs International	(17.949)	(0,00)
(31.625)	Halliburton Co	JPMorgan Chase Bank	(1.748)	(0,00)
(7.237)	Hanesbrands Inc	Morgan Stanley	(3.269)	(0,00)
1.012	Hanmi Financial Corp	Morgan Stanley	(370)	(0,00)
42.476	Hanover Insurance Group Inc	Morgan Stanley	(554)	(0,00)
699.802	Harley-Davidson Inc	Morgan Stanley	(80.362)	(0,01)
1.515	Harmony Biosciences Holdings Inc	Morgan Stanley	(671)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(2.723)	Hartford Financial Services Group Inc	Morgan Stanley	(890)	(0,00)
14.707	Hasbro Inc	Morgan Stanley	(3.031)	(0,00)
941	Hawkins Inc	Morgan Stanley	(1.448)	(0,00)
36.615	Hayward Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.524)	(0,00)
903	HB Fuller Co	Morgan Stanley	(780)	(0,00)
790.064	HCA Healthcare Inc	Goldman Sachs International	(73.451)	(0,01)
74.365	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	(6.539)	(0,00)
66.199	Healthcare Realty Trust Inc	Morgan Stanley	(11.975)	(0,00)
(2.840)	HealthEquity Inc	Morgan Stanley	(2.989)	(0,00)
2.096	Healthpeak Properties Inc	Morgan Stanley	(47)	(0,00)
100	Heartland Financial USA Inc	Morgan Stanley	(25)	(0,00)
112	Hecla Mining Co	Morgan Stanley	(20)	(0,00)
71.402	Heico Corp	Morgan Stanley	(7.928)	(0,00)
8.471	Helix Energy Solutions Group Inc	Morgan Stanley	(3.123)	(0,00)
73.907	Henry Schein Inc	Morgan Stanley	(10.217)	(0,00)
31.566	Henry Schein Inc	Goldman Sachs International	(4.444)	(0,00)
2.603	Hercules Capital Inc	Morgan Stanley	(46)	(0,00)
261	Heritage Financial Corp	Morgan Stanley	(8)	(0,00)
(135.711)	Hershey Co	Morgan Stanley	(7.572)	(0,00)
(343.074)	Hershey Co	Goldman Sachs International	(169.132)	(0,01)
(15.582)	Hertz Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.684)	(0,00)
72.423	Hess Corp	Morgan Stanley	(1.734)	(0,00)
42.066	Hexcel Corp	Morgan Stanley	(3.549)	(0,00)
(215.362)	HF Sinclair Corp	Morgan Stanley	(10.451)	(0,00)
(305.818)	HF Sinclair Corp	JPMorgan Chase Bank	(13.050)	(0,00)
(209)	Hillenbrand Inc	Morgan Stanley	(298)	(0,00)
74.340	Hilton Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	(6.788)	(0,00)
716	Holley Inc	Morgan Stanley	(77)	(0,00)
(936.914)	Home Depot Inc	JPMorgan Chase Bank	(10.149)	(0,00)
2.160	Home Depot Inc	Morgan Stanley	(8.867)	(0,00)
68.564	Honeywell International Inc	Morgan Stanley	(11.581)	(0,00)
387.830	Hormel Foods Corp	JPMorgan Chase Bank	(5.742)	(0,00)
239.763	Hormel Foods Corp	Goldman Sachs International	(873)	(0,00)
280	Host Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	(32)	(0,00)
41.845	Houlihan Lokey Inc	Morgan Stanley	(5.957)	(0,00)
379.817	Howmet Aerospace Inc	JPMorgan Chase Bank	(47.640)	(0,01)
73.312	Howmet Aerospace Inc	Morgan Stanley	(3.606)	(0,00)
58.280	HP Inc	Morgan Stanley	(4.147)	(0,00)
(3.859)	Hudson Pacific Properties Inc	Morgan Stanley	(806)	(0,00)
(125.051)	Humana Inc	Morgan Stanley	(8.564)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
67.839	Humana Inc	Goldman Sachs International	(226)	(0,00)
4.652	Huntsman Corp	Morgan Stanley	(2.526)	(0,00)
67.762	Hyatt Hotels Corp Class A	Morgan Stanley	(17.260)	(0,00)
(3.297)	IAC Inc	Morgan Stanley	(527)	(0,00)
398.027	Iberdrola SA	Goldman Sachs International	(64.096)	(0,01)
1.030.195	ICON Plc	Goldman Sachs International	(51.544)	(0,01)
39.185	IDACORP Inc	Morgan Stanley	(4.198)	(0,00)
(797)	Ideaya Biosciences Inc	Morgan Stanley	(1.235)	(0,00)
56.403	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs International	(22.272)	(0,00)
13.388	IDEXX Laboratories Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.680)	(0,00)
(1)	Illinois Tool Works Inc	Morgan Stanley	(0)	(0,00)
(560)	Immunovant Inc	Morgan Stanley	(2.828)	(0,00)
(511.483)	Imperial Oil Ltd	JPMorgan Chase Bank	(7.082)	(0,00)
(139.478)	Imperial Oil Ltd	Morgan Stanley	(604)	(0,00)
484.933	Incyte Corp	JPMorgan Chase Bank	(31.075)	(0,00)
130.380	Incyte Corp	Goldman Sachs International	(3.395)	(0,00)
(96)	indie Semiconductor Inc Class A	Morgan Stanley	(7)	(0,00)
55.371	Informatica Inc Class A	Morgan Stanley	(6.958)	(0,00)
56.161	Ingersoll Rand Inc	Morgan Stanley	(32.703)	(0,00)
(34)	Ingredion Inc	Morgan Stanley	(43)	(0,00)
(299)	Innovative Industrial Properties Inc	Morgan Stanley	(334)	(0,00)
(9.541)	Innoviva Inc	Morgan Stanley	(308)	(0,00)
(1.250)	Insmed Inc	Morgan Stanley	(3.422)	(0,00)
9.522	Inspire Medical Systems Inc	Morgan Stanley	(3.838)	(0,00)
284	Installed Building Products Inc	Morgan Stanley	(295)	(0,00)
(871)	Insteel Industries Inc	Morgan Stanley	(383)	(0,00)
3.949	Intapp Inc	Morgan Stanley	(3.254)	(0,00)
(399)	Integer Holdings Corp	Morgan Stanley	(200)	(0,00)
838	Integral Ad Science Holding Corp	Morgan Stanley	(695)	(0,00)
(12.855)	Intel Corp	Morgan Stanley	(52.006)	(0,01)
(1.499)	Intellia Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(139)	(0,00)
(811)	Interactive Brokers Group Inc Class A	Morgan Stanley	(488)	(0,00)
68.267	Intercontinental Exchange Inc	Morgan Stanley	(22.742)	(0,00)
(3.821)	International Business Machines Corp	Morgan Stanley	(9.083)	(0,00)
100	International Business Machines Corp	Goldman Sachs International	(17)	(0,00)
203.646	International Consolidated Airlines Group SA	Société Générale	(1.490)	(0,00)
59.759	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	(19.943)	(0,00)
6.092	International Money Express Inc	Morgan Stanley	(417)	(0,00)
(232.422)	Intesa Sanpaolo	Goldman Sachs International	(7.983)	(0,00)
65.938	Intuit Inc	Morgan Stanley	(14.132)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
313.493	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs International	(22.531)	(0,00)
(112)	Intuitive Surgical Inc	Morgan Stanley	(582)	(0,00)
86.064	Invitation Homes Inc	Morgan Stanley	(4.013)	(0,00)
64.754	Ionis Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(15.036)	(0,00)
37.190	Ionis Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(6.300)	(0,00)
(8.895)	Iovance Biotherapeutics Inc	Morgan Stanley	(5.796)	(0,00)
16.523	Ipsen	Goldman Sachs International	(642)	(0,00)
73.388	IQVIA Holdings Inc	Morgan Stanley	(10.247)	(0,00)
5.485	Iron Mountain Inc	Morgan Stanley	(524)	(0,00)
71.511	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(10.401)	(0,00)
133.067	Jabil Inc	Morgan Stanley	(4.962)	(0,00)
37.180	Jack Henry & Associates Inc	Morgan Stanley	(5.606)	(0,00)
401.038	Jacobs Solutions Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.970)	(0,00)
75.215	Jacobs Solutions Inc	Goldman Sachs International	(1.421)	(0,00)
346	Jacobs Solutions Inc	Morgan Stanley	(33)	(0,00)
266	James River Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	(107)	(0,00)
5.498	Janus Henderson Group Plc	Morgan Stanley	(820)	(0,00)
(1.293)	Janus International Group Inc	Morgan Stanley	(841)	(0,00)
109.468	Jazz Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs International	(2.894)	(0,00)
(140.383)	Jazz Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	(2.889)	(0,00)
19.363	Jazz Pharmaceuticals Plc	JPMorgan Chase Bank	(157)	(0,00)
33.050	JB Hi-Fi Ltd	JPMorgan Chase Bank	(5.247)	(0,00)
74.437	JB Hunt Transport Services Inc	Morgan Stanley	(6.450)	(0,00)
126.259	Jeronimo Martins SGPS SA	JPMorgan Chase Bank	(1.591)	(0,00)
154.994	Jeronimo Martins SGPS SA	Goldman Sachs International	(331)	(0,00)
1.958	JetBlue Airways Corp	Morgan Stanley	(427)	(0,00)
307	JFrog Ltd	Morgan Stanley	(47)	(0,00)
(153)	JM Smucker Co	Morgan Stanley	(147)	(0,00)
2.743	John Wiley & Sons Inc Class A	Morgan Stanley	(4.755)	(0,00)
(1.078)	Johnson & Johnson	Morgan Stanley	(2.702)	(0,00)
611.455	Johnson & Johnson	JPMorgan Chase Bank	(16.333)	(0,00)
285.702	Johnson & Johnson	Goldman Sachs International	(10.360)	(0,00)
216.039	Johnson Controls International Plc	JPMorgan Chase Bank	(16.808)	(0,00)
(1.384)	Johnson Controls International Plc	Morgan Stanley	(708)	(0,00)
(1.923)	JPMorgan Chase & Co	Morgan Stanley	(4.579)	(0,00)
(10.930)	Juniper Networks Inc	Morgan Stanley	(2.353)	(0,00)
35.568	Karuna Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(180.970)	(0,02)
(2.495)	KB Home	Morgan Stanley	(718)	(0,00)
(2.254)	KBR Inc	Morgan Stanley	(2.659)	(0,00)
70.849	Kellogg Co	Morgan Stanley	(8.386)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
173.910	Kellogg Co	Goldman Sachs International	(9.270)	(0,00)
738.620	Kellogg Co	JPMorgan Chase Bank	(40.004)	(0,00)
39.817	Kemper Corp	Morgan Stanley	(6.804)	(0,00)
442.026	Kennametal Inc	JPMorgan Chase Bank	(27.671)	(0,00)
3.618	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Morgan Stanley	(44)	(0,00)
65.346	Kenvue Inc	Morgan Stanley	(10.533)	(0,00)
206.510	Kenvue Inc	Goldman Sachs International	(2.896)	(0,00)
(226.171)	Kenvue Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.884)	(0,00)
449.788	Kering SA	JPMorgan Chase Bank	(2.585)	(0,00)
(198.399)	Keurig Dr Pepper Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.283)	(0,00)
(503.640)	Keurig Dr Pepper Inc	Goldman Sachs International	(5.168)	(0,00)
69.567	Keurig Dr Pepper Inc	Morgan Stanley	(5.908)	(0,00)
77.839	Kimco Realty Corp	Morgan Stanley	(12.043)	(0,00)
127.463	Kinder Morgan Inc	JPMorgan Chase Bank	(466)	(0,00)
65.298	Kinder Morgan Inc	Morgan Stanley	(6.770)	(0,00)
501.655	Kinder Morgan Inc	Goldman Sachs International	(13.187)	(0,00)
275	Kinsale Capital Group Inc	Morgan Stanley	(570)	(0,00)
185	Kirby Corp	Morgan Stanley	(273)	(0,00)
4.522	Kite Realty Group Trust	Morgan Stanley	(662)	(0,00)
59.515	KKR & Co Inc	Morgan Stanley	(23.631)	(0,00)
149.639	KLA Corp	Morgan Stanley	(24.451)	(0,00)
106	Knife River Corp	Morgan Stanley	(18)	(0,00)
452	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Morgan Stanley	(258)	(0,00)
763.103	Kohls Corp	JPMorgan Chase Bank	(31.811)	(0,00)
389.513	Kohls Corp	Goldman Sachs International	(99.122)	(0,01)
60.186	Kraft Heinz Co	Morgan Stanley	(10.617)	(0,00)
(38.758.500)	KraneShares CSI China Internet ETF	Morgan Stanley	(13.500)	(0,00)
(12.401)	Krispy Kreme Inc	Morgan Stanley	(1.988)	(0,00)
252.750	Kroger Co	JPMorgan Chase Bank	(6.300)	(0,00)
332.393	Kroger Co	Goldman Sachs International	(8.207)	(0,00)
(6.606)	Kroger Co	Morgan Stanley	(3.740)	(0,00)
(998)	Kronos Worldwide Inc	Morgan Stanley	(96)	(0,00)
(516)	Kura Oncology Inc	Morgan Stanley	(873)	(0,00)
33.104	Kymera Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(27.288)	(0,00)
95.474	Kymera Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(23.573)	(0,00)
(1.234.214)	L&F Co Ltd	Goldman Sachs International	(11.139)	(0,00)
66.996	Laboratory Corp of America Holdings	Morgan Stanley	(26.237)	(0,00)
970.349	Laboratory Corp of America Holdings	Goldman Sachs International	(92.988)	(0,01)
18.655	Ladder Capital Corp	Morgan Stanley	(4.768)	(0,00)
455	Lamar Advertising Co Class A	Morgan Stanley	(445)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
418	Lattice Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(538)	(0,00)
900	Laureate Education Inc	Morgan Stanley	(207)	(0,00)
581.849	Lear Corp	JPMorgan Chase Bank	(24.139)	(0,00)
920.862	Lear Corp	Goldman Sachs International	(32.706)	(0,01)
(278.307)	Legend Biotech Corp	JPMorgan Chase Bank	(11.806)	(0,00)
(6.490)	Legend Biotech Corp	Goldman Sachs International	(159)	(0,00)
1.530	Leggett & Platt Inc	Morgan Stanley	(42)	(0,00)
(2.768)	LendingClub Corp	Morgan Stanley	(207)	(0,00)
36.908	Lennar Corp Class B	Morgan Stanley	(12.320)	(0,00)
(3.870)	Leonardo DRS Inc	Morgan Stanley	(4.286)	(0,00)
(278)	Leslie's Inc	Morgan Stanley	(6)	(0,00)
713.739	Levi Strauss & Co Class A	JPMorgan Chase Bank	(78.304)	(0,01)
(6.006)	Levi Strauss & Co Class A	Morgan Stanley	(5.691)	(0,00)
(3.843)	Liberty Broadband Corp Class C	Morgan Stanley	(8.894)	(0,00)
(32.515)	Liberty Global Ltd Class C	Morgan Stanley	(38.157)	(0,01)
69.441	Liberty Media Corp	Morgan Stanley	(8.537)	(0,00)
84.121	Liberty Media Corp Class A	Morgan Stanley	(4.885)	(0,00)
(83.089)	Liberty Media Corp Class C	Morgan Stanley	(4.577)	(0,00)
(490.225)	Life Time Group Holdings Inc	Morgan Stanley	(23.093)	(0,00)
(8.105)	LifeStance Health Group Inc	Morgan Stanley	(3.527)	(0,00)
994	Lincoln National Corp	Morgan Stanley	(431)	(0,00)
66.867	Linde Plc	Morgan Stanley	(7.590)	(0,00)
(870)	Lithia Motors Inc	Morgan Stanley	(14.194)	(0,00)
42.858	Littelfuse Inc	Morgan Stanley	(6.642)	(0,00)
8.849	Live Nation Entertainment Inc	JPMorgan Chase Bank	(781)	(0,00)
44.629	Live Nation Entertainment Inc	Goldman Sachs International	(4.912)	(0,00)
(2.616)	LKQ Corp	Morgan Stanley	(45)	(0,00)
(357.021)	Lloyds Banking Group Plc	Goldman Sachs International	(40.283)	(0,01)
213.587	Lockheed Martin Corp	Goldman Sachs International	(1.680)	(0,00)
93.538	Lockheed Martin Corp	JPMorgan Chase Bank	(1.433)	(0,00)
77.821	Loews Corp	Morgan Stanley	(1.126)	(0,00)
(470)	Logitech International S.A.	Morgan Stanley	(932)	(0,00)
173.382	L'Oreal	Goldman Sachs International	(22.057)	(0,00)
1.262.671	Lowe's Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	(84.575)	(0,01)
74.338	Lowe's Cos Inc	Morgan Stanley	(8.301)	(0,00)
(656)	LSB Industries Inc	Morgan Stanley	(10)	(0,00)
357.228	Lululemon Athletica Inc	JPMorgan Chase Bank	(12.732)	(0,00)
43.521	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	(7.705)	(0,00)
6.574	Lyft Inc Class A	Morgan Stanley	(2.485)	(0,00)
(216)	M/I Homes Inc	Morgan Stanley	(1.986)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(1.035)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Morgan Stanley	(73)	(0,00)
(7.697)	Macy's Inc	Morgan Stanley	(454)	(0,00)
(546.469)	Macy's Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.811)	(0,00)
(5.617)	Madison Square Garden Entertainment Corp	JPMorgan Chase Bank	(13)	(0,00)
(55.053)	Madison Square Garden Entertainment Corp	Goldman Sachs International	(370)	(0,00)
448	Madison Square Garden Entertainment Corp	Morgan Stanley	(9)	(0,00)
(1.071)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(6.669)	(0,00)
253.330	Magna International Inc	JPMorgan Chase Bank	(6.116)	(0,00)
455.034	Magna International Inc	Goldman Sachs International	(6.368)	(0,00)
(1.649)	Magna International Inc	Morgan Stanley	(1.338)	(0,00)
368.579	Magnolia Oil & Gas Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(25.717)	(0,00)
(62)	MakeMyTrip Ltd	Morgan Stanley	(89)	(0,00)
1.340	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	(6.156)	(0,00)
(13.812)	Marathon Digital Holdings Inc	Morgan Stanley	(8.851)	(0,00)
431.906	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs International	(15.407)	(0,00)
(838.067)	Marathon Oil Corp	JPMorgan Chase Bank	(46.967)	(0,01)
558	Marathon Petroleum Corp	Morgan Stanley	(2.755)	(0,00)
117.316	Marathon Petroleum Corp	JPMorgan Chase Bank	(1.162)	(0,00)
(110.913)	Maravai LifeSciences Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(22.185)	(0,00)
(265)	Marcus & Millichap Inc	Morgan Stanley	(445)	(0,00)
(288)	MarineMax Inc	Morgan Stanley	(567)	(0,00)
73.611	Markel Group Inc	Morgan Stanley	(172)	(0,00)
65.913	MarketAxess Holdings Inc	Morgan Stanley	(26.311)	(0,00)
925.787	Marriott International Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(110.551)	(0,01)
53.832	Marriott International Inc Class A	Goldman Sachs International	(4.092)	(0,00)
70.215	Marriott International Inc Class A	Morgan Stanley	(12.461)	(0,00)
(352)	Marsh & McLennan Cos Inc	Morgan Stanley	(193)	(0,00)
1.581.697	Martin Marietta Materials Inc	Goldman Sachs International	(186.880)	(0,02)
129.634	Martin Marietta Materials Inc	JPMorgan Chase Bank	(11.772)	(0,00)
84.434	Marvell Technology Inc	Morgan Stanley	(13.368)	(0,00)
5.659	Masco Corp	Morgan Stanley	(3.566)	(0,00)
39.340	Masimo Corp	Morgan Stanley	(13.795)	(0,00)
144.951	MasTec Inc	Goldman Sachs International	(16.893)	(0,00)
41.746	MasTec Inc	Morgan Stanley	(13.833)	(0,00)
63.758	Mastercard Inc Class A	Morgan Stanley	(4.324)	(0,00)
503	Matthews International Corp Class A	Morgan Stanley	(298)	(0,00)
688.738	McCormick & Co Inc	Morgan Stanley	(76.142)	(0,01)
(217)	McDonald's Corp	Morgan Stanley	(693)	(0,00)
669.945	McKesson Corp	Goldman Sachs International	(9.628)	(0,00)
16	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	(1)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
218	Medical Properties Trust Inc	Morgan Stanley	(34)	(0,00)
(4.939)	Medtronic Plc	Morgan Stanley	(4.955)	(0,00)
64.289	Meituan Class B	Société Générale	(24)	(0,00)
116	MercadoLibre Inc	Morgan Stanley	(5.193)	(0,00)
(363)	Merchants Bancorp	Morgan Stanley	(262)	(0,00)
(519.863)	Merck & Co Inc	JPMorgan Chase Bank	(21.783)	(0,00)
173.384	Merck KGaA	JPMorgan Chase Bank	(12.704)	(0,00)
291.922	Merck KGaA	Goldman Sachs International	(11.067)	(0,00)
44.532	Mercury Systems Inc	Morgan Stanley	(784)	(0,00)
(464)	Meritage Homes Corp	Morgan Stanley	(347)	(0,00)
(1.794)	Meta Platforms Inc	Morgan Stanley	(4.492)	(0,00)
56.794	Mettler-Toledo International Inc	Goldman Sachs International	(1.380)	(0,00)
22.794	Mettler-Toledo International Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.657)	(0,00)
74.316	Mettler-Toledo International Inc	Morgan Stanley	(8.097)	(0,00)
1.450	MFA Financial Inc	Morgan Stanley	(645)	(0,00)
(100)	MGE Energy Inc	Morgan Stanley	(115)	(0,00)
1.228	MGIC Investment Corp	Morgan Stanley	(230)	(0,00)
125.514	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	(9.923)	(0,00)
59.366	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	(42.139)	(0,00)
(109.618)	Microsoft Corp	Morgan Stanley	(3.387)	(0,00)
19.664	MiMedx Group Inc	Morgan Stanley	(5.666)	(0,00)
42.160	Mirati Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(1.384)	(0,00)
45.891	Mister Car Wash Inc	Morgan Stanley	(8.666)	(0,00)
287.721	Moderna Inc	JPMorgan Chase Bank	(70.243)	(0,01)
74.344	Moderna Inc	Goldman Sachs International	(20.759)	(0,00)
(13.780)	Moderna Inc	Morgan Stanley	(159.196)	(0,01)
398	Moelis & Co Class A	Morgan Stanley	(220)	(0,00)
116.404	Mohawk Industries Inc	Goldman Sachs International	(5.571)	(0,00)
366.447	Mohawk Industries Inc	JPMorgan Chase Bank	(61.490)	(0,01)
91	Mohawk Industries Inc	Morgan Stanley	(4)	(0,00)
388.771	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs International	(3)	(0,00)
(980)	Molina Healthcare Inc	Morgan Stanley	(8.434)	(0,00)
240.978	Molson Coors Beverage Co Class B	JPMorgan Chase Bank	(6.846)	(0,00)
611.938	Molson Coors Beverage Co Class B	Morgan Stanley	(34.898)	(0,01)
103	Monday.com Ltd	Morgan Stanley	(535)	(0,00)
66.900	Mondelez International Inc Class A	Morgan Stanley	(13.605)	(0,00)
(55.172)	MongoDB Inc	Morgan Stanley	(5.822)	(0,00)
(5.361)	MongoDB Inc	JPMorgan Chase Bank	(59)	(0,00)
(1.661)	MongoDB Inc	Goldman Sachs International	(29)	(0,00)
47.048	Monolithic Power Systems Inc	Morgan Stanley	(19.708)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
388	Monro Inc	Morgan Stanley	(894)	(0,00)
(4.366)	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	(13.023)	(0,00)
327	Mosaic Co	Morgan Stanley	(188)	(0,00)
38.828	MP Materials Corp	Morgan Stanley	(12.422)	(0,00)
168.285	Murphy Oil Corp	Goldman Sachs International	(11.561)	(0,00)
428.918	Murphy Oil Corp	JPMorgan Chase Bank	(7.637)	(0,00)
3.449	Murphy Oil Corp	Morgan Stanley	(4.130)	(0,00)
190.018	Murphy USA Inc	JPMorgan Chase Bank	(562)	(0,00)
569.786	Murphy USA Inc	Goldman Sachs International	(2.310)	(0,00)
6.090	Myriad Genetics Inc	Morgan Stanley	(9.201)	(0,00)
63.592	Nasdaq Inc	Morgan Stanley	(13.147)	(0,00)
(1.319.961)	Naspers Ltd	Morgan Stanley	(2.243)	(0,00)
(4.535.952)	Naspers Ltd	Goldman Sachs International	(16.856)	(0,00)
33.193	Natera Inc	Morgan Stanley	(13.407)	(0,00)
(77.843)	National Fuel Gas Co	Morgan Stanley	(351)	(0,00)
91.591	National Grid Plc	Goldman Sachs International	(12.279)	(0,00)
32.222	National Storage Affiliates Trust	Morgan Stanley	(16.585)	(0,00)
(4.416)	Navitas Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(349)	(0,00)
40.338	nCino Inc	Morgan Stanley	(7.678)	(0,00)
(4.365)	NCR Voyix Corp	Morgan Stanley	(2.021)	(0,00)
4.898.911	Nedbank Group Ltd	JPMorgan Chase Bank	(9.718)	(0,00)
55.999	NetApp Inc	Morgan Stanley	(9.450)	(0,00)
110.326	Netflix Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.686)	(0,00)
10.092	Netflix Inc	Goldman Sachs International	(112)	(0,00)
1.776	NETGEAR Inc	Morgan Stanley	(308)	(0,00)
1.697	NetScout Systems Inc	Morgan Stanley	(1.386)	(0,00)
(2.460)	NETSTREIT Corp	Morgan Stanley	(695)	(0,00)
38.752	Neurocrine Biosciences Inc	Goldman Sachs International	(15.644)	(0,00)
34.183	New Fortress Energy Inc	Morgan Stanley	(7.983)	(0,00)
(8.453)	New Fortress Energy Inc Class A	Morgan Stanley	(9.974)	(0,00)
100	New Mountain Finance Corp	Morgan Stanley	(31)	(0,00)
4.463	New York Mortgage Trust Inc	Morgan Stanley	(1.448)	(0,00)
76.984	New York Times Co Class A	JPMorgan Chase Bank	(9.734)	(0,00)
43.736	New York Times Co Class A	Goldman Sachs International	(6.414)	(0,00)
10.081	New York Times Co Class A	Morgan Stanley	(2.012)	(0,00)
196.414	Newell Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	(19.647)	(0,00)
217.084	Newell Brands Inc	Goldman Sachs International	(32.447)	(0,01)
41.029	Newell Brands Inc	Morgan Stanley	(2.109)	(0,00)
36.848	Newmarket Corp	Morgan Stanley	(7.829)	(0,00)
64.155	Newmont Corp	Morgan Stanley	(10.970)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
54.244	News Corp Class A	Goldman Sachs International	(5.337)	(0,00)
52.163	News Corp Class A	Morgan Stanley	(24.009)	(0,00)
21.938	News Corp Class A	JPMorgan Chase Bank	(1.659)	(0,00)
(672)	NexGen Energy Ltd	Morgan Stanley	(125)	(0,00)
(13.597)	NextDecade Corp	Morgan Stanley	(1.991)	(0,00)
(4.384)	NextEra Energy Partners LP	Morgan Stanley	(967)	(0,00)
66.361	NEXTracker Inc Class A	Morgan Stanley	(7.320)	(0,00)
2.632	NIKE Inc Class B	Morgan Stanley	(6.166)	(0,00)
1.556	NMI Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(34)	(0,00)
(97.032)	NN Group NV	Goldman Sachs International	(126)	(0,00)
417.546	Noble Corp Plc	Goldman Sachs International	(63.156)	(0,01)
(1.619)	Noble Corp Plc	Morgan Stanley	(2.520)	(0,00)
1.054	Nomad Foods Ltd	Morgan Stanley	(22)	(0,00)
(75.718)	Nordex SE	Goldman Sachs International	(85)	(0,00)
69.438	Nordson Corp	Morgan Stanley	(20.502)	(0,00)
(5.767)	Nordstrom Inc	Morgan Stanley	(1.833)	(0,00)
(1.352)	Norfolk Southern Corp	Morgan Stanley	(6.068)	(0,00)
73.776	Northern Trust Corp	Morgan Stanley	(5.766)	(0,00)
246.711	NOV Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.915)	(0,00)
(41.994)	NOV Inc	Morgan Stanley	(3.381)	(0,00)
(125.832)	Novartis AG	JPMorgan Chase Bank	(920)	(0,00)
54.733	NRG Energy Inc	Morgan Stanley	(29.504)	(0,00)
(4.682)	NU Holdings Ltd Class A	JPMorgan Chase Bank	(79)	(0,00)
1.384	Nu Skin Enterprises Inc Class A	Morgan Stanley	(159)	(0,00)
(445)	Nurix Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(136)	(0,00)
1.037	Nutrien Ltd	Morgan Stanley	(259)	(0,00)
(76)	nVent Electric Plc	Morgan Stanley	(15)	(0,00)
(615)	NXP Semiconductors NV	Morgan Stanley	(2.520)	(0,00)
1.929	Oaktree Specialty Lending Corp	Morgan Stanley	(370)	(0,00)
(285.497)	Occidental Petroleum Corp	Morgan Stanley	(6.255)	(0,00)
(19.893)	Occidental Petroleum Corp	JPMorgan Chase Bank	(6.859)	(0,00)
20.845	Oddity Tech Ltd Class A	JPMorgan Chase Bank	(3.605)	(0,00)
41.856	OGE Energy Corp	Morgan Stanley	(4.089)	(0,00)
369	O-I Glass Inc	Morgan Stanley	(63)	(0,00)
73.883	Okta Inc	Morgan Stanley	(21.109)	(0,00)
(647)	Okta Inc Class A	Morgan Stanley	(2.262)	(0,00)
14.458	Olaplex Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.496)	(0,00)
1.174.935	Old Dominion Freight Line	Goldman Sachs International	(47.758)	(0,01)
444.774	Old Dominion Freight Line	JPMorgan Chase Bank	(37.592)	(0,01)
1.339	Old Dominion Freight Line Inc	Morgan Stanley	(2.151)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(13.712)	Old National Bancorp	Morgan Stanley	(401)	(0,00)
34.302	Olin Corp	Morgan Stanley	(5.191)	(0,00)
(21)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	(17)	(0,00)
(1.365)	OmniAb Inc	Morgan Stanley	(635)	(0,00)
(19.718)	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(17.407)	(0,00)
72	OneMain Holdings Inc	Morgan Stanley	(32)	(0,00)
121.434	ONEOK Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.508)	(0,00)
580.328	ONEOK Inc	Goldman Sachs International	(37.460)	(0,01)
67.955	ONEOK Inc	Morgan Stanley	(9.364)	(0,00)
24	OneSpan Inc	Morgan Stanley	(15)	(0,00)
(1.575)	Open Text Corp	Morgan Stanley	(435)	(0,00)
126.395	Option Care Health Inc	Goldman Sachs International	(25.810)	(0,00)
472	Option Care Health Inc	Morgan Stanley	(77)	(0,00)
(23.888)	Oracle Corp	JPMorgan Chase Bank	(1.540)	(0,00)
(117.854)	Oracle Corp	Morgan Stanley	(1.687)	(0,00)
(4.086)	OraSure Technologies Inc	Morgan Stanley	(1.016)	(0,00)
264	O'Reilly Automotive Inc	Morgan Stanley	(1.554)	(0,00)
(103.362)	Organon & Co	Morgan Stanley	(6.537)	(0,00)
83.126	Orion Oyj	Goldman Sachs International	(7.944)	(0,00)
143.177	Orion Oyj	JPMorgan Chase Bank	(10.559)	(0,00)
8.276	Ormat Technologies Inc	Morgan Stanley	(325)	(0,00)
187.062	Ormat Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(25.716)	(0,00)
70.778	Otis Worldwide Corp	Morgan Stanley	(9.111)	(0,00)
(691)	Otter Tail Corp	Morgan Stanley	(436)	(0,00)
8.701	Outfront Media Inc	Morgan Stanley	(1.212)	(0,00)
(489.361)	Ovintiv Inc	JPMorgan Chase Bank	(8.786)	(0,00)
(522.456)	Ovintiv Inc	Goldman Sachs International	(15.871)	(0,00)
704	Owens & Minor Inc	Morgan Stanley	(808)	(0,00)
165	Owens Corning	Morgan Stanley	(53)	(0,00)
73.825	PACCAR Inc	Morgan Stanley	(5.138)	(0,00)
571	Pacific Premier Bancorp Inc	Morgan Stanley	(34)	(0,00)
37.045	Pacira BioSciences Inc	JPMorgan Chase Bank	(6.205)	(0,00)
451	Packaging Corp of America	Morgan Stanley	(314)	(0,00)
5.227	PagerDuty Inc	Morgan Stanley	(3.941)	(0,00)
(657)	Pagseguro Digital Ltd Class A	Morgan Stanley	(279)	(0,00)
54.887	Palantir Technologies Inc Class A	Morgan Stanley	(5.411)	(0,00)
(5.471)	Pan American Silver Corp	Morgan Stanley	(1.065)	(0,00)
(303)	Papa John's International Inc	Morgan Stanley	(965)	(0,00)
(814)	Par Pacific Holdings Inc	Morgan Stanley	(471)	(0,00)
453.937	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs International	(5.192)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
904	Patterson-UTI Energy Inc	Morgan Stanley	(248)	(0,00)
228.034	Paychex Inc	JPMorgan Chase Bank	(10.666)	(0,00)
1.151	Paychex Inc	Morgan Stanley	(623)	(0,00)
462	Paycor HCM Inc	Morgan Stanley	(53)	(0,00)
128.605	Paylocity Holding Corp	JPMorgan Chase Bank	(5.260)	(0,00)
96.394	Paylocity Holding Corp	Goldman Sachs International	(4.701)	(0,00)
351	Paylocity Holding Corp	Morgan Stanley	(47)	(0,00)
(394)	Payoneer Global Inc	Morgan Stanley	(90)	(0,00)
3.404	PayPal Holdings Inc	Morgan Stanley	(8.781)	(0,00)
(2.095)	PayPal Holdings Inc	Goldman Sachs International	(41)	(0,00)
(8.885)	Peabody Energy Corp	Morgan Stanley	(1.453)	(0,00)
25.550.000	Peabody Energy Corp	Nomura	(1.505.320)	(0,10)
1.463	Peakstone Realty Trust	Morgan Stanley	(87)	(0,00)
(18.096)	Pebblebrook Hotel Trust	Morgan Stanley	(7.842)	(0,00)
2.449	Pegasystems Inc	Morgan Stanley	(2.415)	(0,00)
1.855	Pembina Pipeline Corp	Morgan Stanley	(435)	(0,00)
40.443	Penn Entertainment Inc	Morgan Stanley	(1.190)	(0,00)
45.824	Penske Automotive Group Inc	Morgan Stanley	(115)	(0,00)
949.300	Pentair Plc	JPMorgan Chase Bank	(30.330)	(0,00)
135.987	Pentair Plc	Goldman Sachs International	(2.987)	(0,00)
42.146	Penumbra Inc	Morgan Stanley	(5.207)	(0,00)
(697.066)	PepsiCo Inc	Goldman Sachs International	(32.681)	(0,01)
1.966	Perdoceo Education Corp	Morgan Stanley	(16)	(0,00)
34.270	Performance Food Group Co	Morgan Stanley	(2.881)	(0,00)
(14.256)	Permian Resources Corp	Morgan Stanley	(3.684)	(0,00)
204.516	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs International	(16.893)	(0,00)
394.450	Petropavlovsk Plc	Morgan Stanley	(5.992)	(0,00)
(44.970)	Pfizer Inc	Morgan Stanley	(43.051)	(0,01)
603.572	Pfizer Inc	JPMorgan Chase Bank	(39.377)	(0,01)
462.110	Pfizer Inc	Goldman Sachs International	(14.072)	(0,00)
57.276	PG&E Corp	Morgan Stanley	(14.762)	(0,00)
(3.265)	Phathom Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(2.180)	(0,00)
(1.193)	Philip Morris International Inc	Morgan Stanley	(396)	(0,00)
107	Phinia Inc	Morgan Stanley	(26)	(0,00)
40.545	Pilgrim's Pride Corp	Morgan Stanley	(3.870)	(0,00)
37.401	Pinnacle Financial Partners Inc	Morgan Stanley	(13.038)	(0,00)
1.690	Pinterest Inc Class A	Goldman Sachs International	(4)	(0,00)
58.551	Pinterest Inc Class A	Morgan Stanley	(23.296)	(0,00)
28.385	Pinterest Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(3.979)	(0,00)
(124.304)	Pioneer Natural Resources Co	Morgan Stanley	(3.185)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
30.085	Planet Fitness Inc Class A	Morgan Stanley	(15.779)	(0,00)
(4.314)	Pliant Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(6.566)	(0,00)
8.402	Plymouth Industrial REIT Inc	Morgan Stanley	(2.449)	(0,00)
(96.218)	Polaris Inc	Morgan Stanley	(3.292)	(0,00)
1.214.483	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	Goldman Sachs International	(9.068)	(0,00)
280.024	Polski Koncern Naftowy ORLEN SA	JPMorgan Chase Bank	(1.354)	(0,00)
65.161	Polymetal International Plc	Morgan Stanley	(140.096)	(0,01)
(71)	Pool Corp	Morgan Stanley	(274)	(0,00)
1.226	Portillo's Inc Class A	Morgan Stanley	(345)	(0,00)
(587)	Portland General Electric Co	Morgan Stanley	(17)	(0,00)
563.436	Porto Seguro SA	Goldman Sachs International	(1.773)	(0,00)
(276.033)	POSCO Holdings Inc	Goldman Sachs International	(894)	(0,00)
10.800.000	POSCO Holdings Inc	Société Générale	(451.587)	(0,03)
42.575	Post Holdings Inc	Morgan Stanley	(2.112)	(0,00)
315.873	Poste Italiane SpA	Goldman Sachs International	(13.858)	(0,00)
(1.611)	PowerSchool Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(289)	(0,00)
10.543	Principal Financial Group Inc	Morgan Stanley	(4.352)	(0,00)
(2.452)	PROCEPT BioRobotics Corp	Morgan Stanley	(3.795)	(0,00)
124.790	PROCEPT BioRobotics Corp	Goldman Sachs International	(10.499)	(0,00)
22.765	Procore Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(157)	(0,00)
29.236	Procore Technologies Inc	Goldman Sachs International	(5.010)	(0,00)
17.449	Procore Technologies Inc	Morgan Stanley	(1.789)	(0,00)
(1.995)	Procter & Gamble Co	Morgan Stanley	(2.648)	(0,00)
(38.190)	Procter & Gamble Co	Goldman Sachs International	(15.777)	(0,00)
2.757	PROG Holdings Inc	Morgan Stanley	(840)	(0,00)
972	Progress Software Corp	Morgan Stanley	(1.083)	(0,00)
63.298	Progressive Corp	Morgan Stanley	(9.510)	(0,00)
(4.160)	Prologis Inc	Morgan Stanley	(4.184)	(0,00)
7.307	ProPetro Holding Corp	Morgan Stanley	(1.538)	(0,00)
39.247	Prosperity Bancshares Inc	Morgan Stanley	(11.425)	(0,00)
(50.355)	Protagonist Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(8.806)	(0,00)
(39.493)	Protagonist Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(8.397)	(0,00)
267	Proto Labs Inc	Morgan Stanley	(65)	(0,00)
3.038	Provident Financial Services Inc	Morgan Stanley	(803)	(0,00)
26	PTC Inc	Morgan Stanley	(19)	(0,00)
(10.212)	Public Service Enterprise Group Inc	Morgan Stanley	(2.772)	(0,00)
(662)	PVH Corp	Morgan Stanley	(439)	(0,00)
1.758	Q2 Holdings Inc	Morgan Stanley	(215)	(0,00)
38.350	Qiagen NV	Morgan Stanley	(2.086)	(0,00)
25.110	QUALCOMM Inc	Morgan Stanley	(6.198)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
70.089	Quanta Services Inc	Morgan Stanley	(16.448)	(0,00)
34.467	QuantumScape Corp	Morgan Stanley	(5.368)	(0,00)
66.044	Quest Diagnostics Inc	Morgan Stanley	(12.366)	(0,00)
(2.440)	QuidelOrtho Corp	Morgan Stanley	(4.641)	(0,00)
(10.793)	R1 RCM Inc	Morgan Stanley	(3.303)	(0,00)
376	RadNet Inc	Morgan Stanley	(210)	(0,00)
(1.572)	Ramaco Resources Inc Class A	Morgan Stanley	(1.122)	(0,00)
335.860	Range Resources Corp	JPMorgan Chase Bank	(4.613)	(0,00)
(5.491)	Range Resources Corp	Morgan Stanley	(2.451)	(0,00)
(401)	Ranpak Holdings Corp	Morgan Stanley	(168)	(0,00)
2.157	Rapid7 Inc	Morgan Stanley	(3.637)	(0,00)
29.887	Rayonier Inc	Morgan Stanley	(10.559)	(0,00)
(1.718)	RB Global Inc	Morgan Stanley	(3.530)	(0,00)
36.730	RBC Bearings Inc	Morgan Stanley	(20.449)	(0,00)
49.256	Realty Income Corp	Morgan Stanley	(16.795)	(0,00)
(12.493)	Recursion Pharmaceuticals Inc Class A	Morgan Stanley	(562)	(0,00)
257.857	Redeia Corp SA	Goldman Sachs International	(2.359)	(0,00)
100	Redwood Trust Inc	Morgan Stanley	(2)	(0,00)
71.502	Regency Centers Corp	Morgan Stanley	(11.534)	(0,00)
14.420	Regeneron Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.371)	(0,00)
(520.820)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.465)	(0,00)
28.588	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(2.995)	(0,00)
68.301	Regions Financial Corp	Morgan Stanley	(15.034)	(0,00)
(1.940)	Relay Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(721)	(0,00)
71.610	Reliance Steel & Aluminum	Morgan Stanley	(5.584)	(0,00)
10.516	RELX Plc	JPMorgan Chase Bank	(1.943)	(0,00)
27.266	RELX Plc	Goldman Sachs International	(5.224)	(0,00)
1.372	RELX Plc	Morgan Stanley	(247)	(0,00)
1.266.841	Remgro Ltd	Morgan Stanley	(13.455)	(0,00)
2.499.691	Remgro Ltd	JPMorgan Chase Bank	(24.363)	(0,00)
(133.276)	Remitly Global Inc	JPMorgan Chase Bank	(14.854)	(0,00)
(107.378)	Remitly Global Inc	Goldman Sachs International	(2.586)	(0,00)
(36.902)	Remitly Global Inc	Morgan Stanley	(2.844)	(0,00)
(87.031)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Morgan Stanley	(7.607)	(0,00)
64.334	Repligen Corp	Morgan Stanley	(18.450)	(0,00)
32.641	Repligen Corp	Goldman Sachs International	(6.159)	(0,00)
(3.329)	Replimune Group Inc	Morgan Stanley	(2.615)	(0,00)
(791)	Republic Services Inc	Morgan Stanley	(361)	(0,00)
(6.615)	Resideo Technologies Inc	Morgan Stanley	(664)	(0,00)
799	ResMed Inc	Morgan Stanley	(2.476)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
355.268	ResMed Inc	Goldman Sachs International	(36.880)	(0,01)
43.524	ResMed Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.492)	(0,00)
(14.300)	Resolute Forest Products Inc	Morgan Stanley	(8.294)	(0,00)
449	Resources Connection Inc	Morgan Stanley	(24)	(0,00)
780	Restaurant Brands International Inc	Morgan Stanley	(39)	(0,00)
(286)	Retail Opportunity Investments Corp	Morgan Stanley	(15)	(0,00)
(94.915)	REVOLUTION Medicines Inc	Morgan Stanley	(11.199)	(0,00)
(251)	Revvity Inc	Morgan Stanley	(272)	(0,00)
40.109	Rexford Industrial Realty Inc	Morgan Stanley	(8.214)	(0,00)
(1.459)	Rhythm Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.138)	(0,00)
36.362	Rightmove Plc	Goldman Sachs International	(1.706)	(0,00)
36.810	Rightmove Plc	JPMorgan Chase Bank	(3.519)	(0,00)
40.197	RingCentral Inc Class A	Morgan Stanley	(7.284)	(0,00)
732	Rithm Capital Corp	Morgan Stanley	(16)	(0,00)
79.893	Rivian Automotive Inc Class A	Morgan Stanley	(14.866)	(0,00)
(1.062)	Robert Half Inc	Morgan Stanley	(917)	(0,00)
72.038	Robinhood Markets Inc Class A	Morgan Stanley	(25.721)	(0,00)
(1.642)	ROBLOX Corp Class A	Morgan Stanley	(2.320)	(0,00)
637.152	Roche Holding AG	JPMorgan Chase Bank	(4.443)	(0,00)
38.240	Rocket Cos Inc Class A	Morgan Stanley	(22.433)	(0,00)
(2.894)	Rocket Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(4.286)	(0,00)
(77)	Rockwell Automation Inc	Morgan Stanley	(16)	(0,00)
(181)	Rogers Communications Inc	Morgan Stanley	(105)	(0,00)
19.771	Roivant Sciences Ltd	Morgan Stanley	(30.115)	(0,00)
21.188	Roku Inc	JPMorgan Chase Bank	(117)	(0,00)
(19)	Ross Stores Inc	Morgan Stanley	(10)	(0,00)
36.247	Royal Gold Inc	Morgan Stanley	(6.484)	(0,00)
4.186	Royalty Pharma Plc Class A	JPMorgan Chase Bank	(175)	(0,00)
134.074	RPC Inc	Morgan Stanley	(8.249)	(0,00)
4.620	RPM International Inc	Morgan Stanley	(944)	(0,00)
(39.541)	Ryan Specialty Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.445)	(0,00)
2.502	Ryerson Holding Corp	Morgan Stanley	(1.680)	(0,00)
64.169	S&P Global Inc	Morgan Stanley	(23.361)	(0,00)
(6)	Safehold Inc	Morgan Stanley	(1)	(0,00)
(449)	Sage Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(213)	(0,00)
41.973	Saia Inc	Morgan Stanley	(6.684)	(0,00)
43.715	Salesforce Inc	JPMorgan Chase Bank	(13.169)	(0,00)
(2.490)	Sally Beauty Holdings Inc	Morgan Stanley	(276)	(0,00)
134.010	Sampo Oyj Class A	Goldman Sachs International	(10.392)	(0,00)
832	Samsara Inc Class A	Morgan Stanley	(250)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
1.139	SandRidge Energy Inc	Morgan Stanley	(435)	(0,00)
(150)	Sandstorm Gold Ltd	Morgan Stanley	(3)	(0,00)
(7.180)	Sanofi	Morgan Stanley	(480)	(0,00)
(191.928)	Sanofi	JPMorgan Chase Bank	(20.034)	(0,00)
85.344	SAP SE	Morgan Stanley	(13.415)	(0,00)
10.000.000	Sasol Financing USA LLC	Bank of America Merrill Lynch	(1.027.398)	(0,07)
74.919	SBA Communications Corp	Morgan Stanley	(2.404)	(0,00)
119.390	Schlumberger NV	Goldman Sachs International	(8.414)	(0,00)
(573)	Schneider National Inc Class B	Morgan Stanley	(69)	(0,00)
(7.479)	Scholar Rock Holding Corp	Morgan Stanley	(3.769)	(0,00)
(5.339)	Schrodinger Inc	Morgan Stanley	(4.951)	(0,00)
105	Scotts Miracle-Gro Co	Morgan Stanley	(15)	(0,00)
658	Seabridge Gold Inc	Morgan Stanley	(286)	(0,00)
113.265	Seagate Technology Holdings Plc	Morgan Stanley	(43.626)	(0,01)
345.190	SeaWorld Entertainment Inc	JPMorgan Chase Bank	(16.221)	(0,00)
122	Selective Insurance Group Inc	Morgan Stanley	(72)	(0,00)
73.918	Sempra	Morgan Stanley	(1.729)	(0,00)
(2.038)	Sensata Technologies Holding Plc	Morgan Stanley	(819)	(0,00)
34.725	SentinelOne Inc Class A	Morgan Stanley	(25.082)	(0,00)
(4.000)	Seritage Growth Properties	Morgan Stanley	(203)	(0,00)
(8.423)	Service Properties Trust	Morgan Stanley	(820)	(0,00)
(1.232.095)	Shell Plc	JPMorgan Chase Bank	(15.345)	(0,00)
496	Shift4 Payments Inc Class A	Morgan Stanley	(35)	(0,00)
11.812	Shoals Technologies Group Inc Class A	Morgan Stanley	(1.721)	(0,00)
(2.928)	Shoe Carnival Inc	Morgan Stanley	(2.965)	(0,00)
3.384.606	Shoprite Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	(22.848)	(0,00)
105	Shyft Group Inc	Morgan Stanley	(48)	(0,00)
524.085	Sibanye Stillwater Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(0)	(0,00)
42.005	Silgan Holdings Inc	Morgan Stanley	(3.550)	(0,00)
(263)	Silicon Laboratories Inc	Morgan Stanley	(1.004)	(0,00)
(2.356)	Simply Good Foods Co	Morgan Stanley	(1.098)	(0,00)
(6.633)	SiriusPoint Ltd	Morgan Stanley	(564)	(0,00)
20.262	SITE Centers Corp	Morgan Stanley	(3.052)	(0,00)
48.233	SiteOne Landscape Supply Inc	Morgan Stanley	(1.509)	(0,00)
3.370.389	Skandinaviska Enskilda Banken AB	Goldman Sachs International	(38.224)	(0,01)
(283)	Skyline Champion Corp	Morgan Stanley	(3)	(0,00)
53.956	Skyworks Solutions Inc	Morgan Stanley	(7.301)	(0,00)
2.784	Sleep Number Corp	Morgan Stanley	(3.328)	(0,00)
1.223	SmartRent Inc	Morgan Stanley	(77)	(0,00)
(196.292)	Snam SpA	Goldman Sachs International	(222)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(4.400.000)	Snam SpA	BNP Paribas	(431.682)	(0,03)
(8.189)	Snap Inc Class A	Morgan Stanley	(859)	(0,00)
47.305	Snowflake Inc Class A	Goldman Sachs International	(11.501)	(0,00)
(425)	Snowflake Inc Class A	Morgan Stanley	(1.084)	(0,00)
25.549	Snowflake Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(2.171)	(0,00)
35.982	SoFi Technologies Inc	Morgan Stanley	(14.086)	(0,00)
725.861	Sonos Inc	Morgan Stanley	(150.686)	(0,01)
(10.211)	Sotera Health Co	Morgan Stanley	(2.003)	(0,00)
66.612	Southern Co	Morgan Stanley	(355)	(0,00)
71.480	Southwest Airlines Co	Morgan Stanley	(10.264)	(0,00)
431.615	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs International	(46.193)	(0,01)
666.197	Southwest Airlines Co	JPMorgan Chase Bank	(52.605)	(0,01)
(279.473)	Southwestern Energy Co	JPMorgan Chase Bank	(19.244)	(0,00)
(80.615)	Southwestern Energy Co	Morgan Stanley	(4.262)	(0,00)
(3.295)	Sphere Entertainment Co	Morgan Stanley	(97)	(0,00)
25.456	Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(24.039)	(0,00)
28.452	Spotify Technology SA	Goldman Sachs International	(1.267)	(0,00)
2.221	Spotify Technology SA	Morgan Stanley	(2.651)	(0,00)
11.290	SpringWorks Therapeutics Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.910)	(0,00)
7.074	SpringWorks Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(2.937)	(0,00)
1.865	Sprout Social Inc Class A	Morgan Stanley	(5.754)	(0,00)
32.736	Sprout Social Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(5.099)	(0,00)
534.835	Sprouts Farmers Market Inc	Morgan Stanley	(75.899)	(0,01)
913	SSR Mining Inc	Morgan Stanley	(184)	(0,00)
495	STAG Industrial Inc	Morgan Stanley	(68)	(0,00)
854	Standard Motor Products Inc	Morgan Stanley	(674)	(0,00)
546	Stanley Black & Decker Inc	Morgan Stanley	(57)	(0,00)
(2.784)	Star Bulk Carriers Corp	Morgan Stanley	(502)	(0,00)
1.866	Starwood Property Trust Inc	Morgan Stanley	(213)	(0,00)
149	State Street Corp	Morgan Stanley	(17)	(0,00)
351	Steel Dynamics Inc	Morgan Stanley	(1.156)	(0,00)
2.294	Steelcase Inc Class A	Morgan Stanley	(929)	(0,00)
(2.964)	Stellantis NV	Morgan Stanley	(670)	(0,00)
(1.127)	STERIS Plc	Morgan Stanley	(3.341)	(0,00)
6.196	Stitch Fix Inc Class A	Morgan Stanley	(2.441)	(0,00)
(251)	StoneX Group Inc	Morgan Stanley	(1.174)	(0,00)
569	Stride Inc	Morgan Stanley	(226)	(0,00)
628.076	Stryker Corp	Goldman Sachs International	(9.733)	(0,00)
66.896	Sun Communities Inc	Morgan Stanley	(11.046)	(0,00)
795	Sun Country Airlines Holdings Inc	Morgan Stanley	(294)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(1.208)	Sun Life Financial Inc	Morgan Stanley	(227)	(0,00)
(379.185)	Suncor Energy Inc	Morgan Stanley	(880)	(0,00)
(627.477)	Suncor Energy Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.129)	(0,00)
(4.999)	Sunnova Energy International Inc	Morgan Stanley	(2.278)	(0,00)
(7.566)	Sunrun Inc	Morgan Stanley	(6.265)	(0,00)
2.132.871	Swedbank AB	Goldman Sachs International	(3.752)	(0,00)
271.124	Swiss Life Holding AG	Goldman Sachs International	(19.361)	(0,00)
1.389	Symbotic Inc	Morgan Stanley	(2.450)	(0,00)
(783)	Syndax Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1.172)	(0,00)
109	Synopsys Inc	Morgan Stanley	(2.492)	(0,00)
353.397	Sysco Corp	JPMorgan Chase Bank	(16.630)	(0,00)
9.096	Sysco Corp	Morgan Stanley	(284)	(0,00)
63.448	Take-Two Interactive Software Inc	Morgan Stanley	(14.170)	(0,00)
40.014	Tandem Diabetes Care Inc	Morgan Stanley	(24.604)	(0,00)
(748.614)	Tapestry Inc	JPMorgan Chase Bank	(9.030)	(0,00)
2.176	Tapestry Inc	Morgan Stanley	(372)	(0,00)
70.460	Targa Resources Corp	Morgan Stanley	(2.959)	(0,00)
(6.308)	Target Hospitality Corp	Morgan Stanley	(3.683)	(0,00)
(4.864)	Taylor Morrison Home Corp	Morgan Stanley	(116)	(0,00)
(465)	TD SYNNEX Corp	Morgan Stanley	(274)	(0,00)
(68.540)	TechnipFMC Plc	JPMorgan Chase Bank	(7.178)	(0,00)
39.819	TechnipFMC Plc	Morgan Stanley	(478)	(0,00)
36.207	Teladoc Health Inc	Morgan Stanley	(10.201)	(0,00)
74.273	Teledyne Technologies Inc	Morgan Stanley	(22.201)	(0,00)
74.065	Teleflex Inc	Morgan Stanley	(9.129)	(0,00)
(3.998)	Telephone & Data Systems Inc	Morgan Stanley	(32)	(0,00)
(10.740)	TELUS Corp	Morgan Stanley	(822)	(0,00)
42.611	Tempur Sealy International Inc	Morgan Stanley	(9.758)	(0,00)
372.793	Tencent Holdings Ltd	Morgan Stanley	(18.652)	(0,00)
(75.150)	Teradata Corp	Morgan Stanley	(3.416)	(0,00)
(1.805)	Teradyne Inc	Morgan Stanley	(6.258)	(0,00)
295.893	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Goldman Sachs International	(7.183)	(0,00)
(753)	Terns Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(96)	(0,00)
174	Terreno Realty Corp	Morgan Stanley	(0)	(0,00)
8.326	Tetra Tech Inc	Morgan Stanley	(469)	(0,00)
6.546	TETRA Technologies Inc	Morgan Stanley	(1.020)	(0,00)
114.573	Texas Instruments Inc	Morgan Stanley	(5.148)	(0,00)
(130.512)	Texas Pacific Land Corp	Morgan Stanley	(12.189)	(0,00)
27.858	Texas Roadhouse Inc	Morgan Stanley	(5.601)	(0,00)
364	Textron Inc	Morgan Stanley	(52)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
39.497	TFS Financial Corp	Morgan Stanley	(3.668)	(0,00)
15.005	TG Therapeutics Inc	Goldman Sachs International	(16.045)	(0,00)
3.918	TG Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(2.363)	(0,00)
73.400	Thermo Fisher Scientific Inc	Morgan Stanley	(7.188)	(0,00)
163.640	Timken Co	Goldman Sachs International	(754)	(0,00)
70.635	Timken Co	JPMorgan Chase Bank	(1.075)	(0,00)
1.440.866	TJX Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	(82.796)	(0,01)
(2.145)	TJX Cos Inc	Morgan Stanley	(2.111)	(0,00)
3.615	T-Mobile US Inc	JPMorgan Chase Bank	(50)	(0,00)
72.520	T-Mobile US Inc	Morgan Stanley	(8.504)	(0,00)
116.777	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs International	(8.297)	(0,00)
82.964	Toast Inc Class A	Morgan Stanley	(2.396)	(0,00)
592	Toll Brothers Inc	Morgan Stanley	(573)	(0,00)
(9.825)	Topgolf Callaway Brands Corp	Morgan Stanley	(1.707)	(0,00)
140	TORM Plc Class A	Morgan Stanley	(45)	(0,00)
74.185	Toro Co	Morgan Stanley	(11.865)	(0,00)
(4.444)	Toronto-Dominion Bank	Morgan Stanley	(5.820)	(0,00)
15	TPG Inc	Morgan Stanley	(8)	(0,00)
807	TPG RE Finance Trust Inc	Morgan Stanley	(263)	(0,00)
72.692	Tractor Supply Co	Morgan Stanley	(10.711)	(0,00)
175.699	Tractor Supply Co	Goldman Sachs International	(4.729)	(0,00)
1.458.372	Tractor Supply Co	JPMorgan Chase Bank	(104.689)	(0,02)
2.147	Trade Desk Inc Class A	Morgan Stanley	(9.335)	(0,00)
61.242	Tradeweb Markets Inc Class A	Morgan Stanley	(9.082)	(0,00)
65.138	Trane Technologies Plc	Morgan Stanley	(16.895)	(0,00)
577.842	Trane Technologies Plc	JPMorgan Chase Bank	(10.462)	(0,00)
(2.191)	TransMedics Group Inc	Morgan Stanley	(1.632)	(0,00)
53.283	TransUnion	Morgan Stanley	(32.031)	(0,01)
(35.230)	TransUnion	Goldman Sachs International	(901)	(0,00)
41.625	Travel + Leisure Co	Morgan Stanley	(5.482)	(0,00)
74.525	Travelers Cos Inc	Morgan Stanley	(5.439)	(0,00)
(229.720)	TreeHouse Foods Inc	Goldman Sachs International	(41.506)	(0,01)
(785)	TreeHouse Foods Inc	Morgan Stanley	(858)	(0,00)
1.327	TriMas Corp	Morgan Stanley	(1.138)	(0,00)
73.492	Trimble Inc	Morgan Stanley	(11.855)	(0,00)
46.725	Trinet Group Inc	Goldman Sachs International	(2.569)	(0,00)
106.804	Trinet Group Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.470)	(0,00)
18.120	TripAdvisor Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.029)	(0,00)
457	TripAdvisor Inc	Morgan Stanley	(41)	(0,00)
(9.995)	Tronox Holdings Plc Class A	Morgan Stanley	(2.097)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
1.160	TrueBlue Inc	Morgan Stanley	(492)	(0,00)
71.366	Truist Financial Corp	Morgan Stanley	(11.861)	(0,00)
2.601	Trupanion Inc	Morgan Stanley	(3.700)	(0,00)
268	TTEC Holdings Inc	Morgan Stanley	(21)	(0,00)
1.495	TTM Technologies Inc	Morgan Stanley	(153)	(0,00)
15.993	Twelve Seas Investment Company II	Goldman Sachs International	(173)	(0,00)
865	Two Harbors Investment Corp	Morgan Stanley	(244)	(0,00)
69.435	Tyler Technologies Inc	Morgan Stanley	(6.898)	(0,00)
65.837	Tyson Foods Inc Class A	Morgan Stanley	(27.127)	(0,00)
58.425	Uber Technologies Inc	Morgan Stanley	(21.770)	(0,00)
27.389	UCB SA	Goldman Sachs International	(1.585)	(0,00)
14.002	Udemy Inc	Morgan Stanley	(4.577)	(0,00)
37.373	U-Haul Holding Co	Morgan Stanley	(22.491)	(0,00)
60.026	UiPath Inc Class A	Morgan Stanley	(29.684)	(0,00)
59.065	UiPath Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(27.259)	(0,00)
289.854	Ulta Beauty Inc	Goldman Sachs International	(54.395)	(0,01)
534.729	Ulta Beauty Inc	JPMorgan Chase Bank	(10.006)	(0,00)
1.123.305	Ulta Beauty Inc	Morgan Stanley	(172.518)	(0,01)
36.871	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	(14.631)	(0,00)
1.858	United Airlines Holdings Inc	Morgan Stanley	(1.282)	(0,00)
2.336	United Bankshares Inc	Morgan Stanley	(1.567)	(0,00)
2.113	United Community Banks Inc	Morgan Stanley	(956)	(0,00)
1.634	United Fire Group Inc	Morgan Stanley	(532)	(0,00)
1.965.943	United Parcel Service Inc Class B	Goldman Sachs International	(80.826)	(0,01)
20.419	United Parcel Service Inc Class B	Morgan Stanley	(7.527)	(0,00)
(289)	United Rentals Inc	Morgan Stanley	(1.593)	(0,00)
258.547	United Rentals Inc	JPMorgan Chase Bank	(51.705)	(0,01)
(1.701)	United States Steel Corp	Morgan Stanley	(1.217)	(0,00)
(168.802)	United Therapeutics Corp	JPMorgan Chase Bank	(914)	(0,00)
(40.788)	United Therapeutics Corp	Morgan Stanley	(294)	(0,00)
(750.750)	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs International	(2.481)	(0,00)
51.801	Unity Software Inc	JPMorgan Chase Bank	(15.294)	(0,00)
49.486	Unity Software Inc	Morgan Stanley	(53.215)	(0,01)
40.521	Universal Display Corp	Morgan Stanley	(7.976)	(0,00)
620.408	Universal Health Services Inc Class B	Goldman Sachs International	(27.301)	(0,00)
(95.648)	Unum Group	Morgan Stanley	(5.926)	(0,00)
2.876	Upstart Holdings Inc	Morgan Stanley	(13.749)	(0,00)
2.088	Upwork Inc	Morgan Stanley	(138)	(0,00)
(10.904)	Uranium Energy Corp	Morgan Stanley	(407)	(0,00)
20.263	Urban Edge Properties	Morgan Stanley	(3.753)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
923.151	Urban Outfitters Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.339)	(0,00)
125	Urban Outfitters Inc	Morgan Stanley	(70)	(0,00)
61.408	US Bancorp	Morgan Stanley	(22.222)	(0,00)
341	US Silica Holdings Inc	Morgan Stanley	(17)	(0,00)
80.737	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs International	(13.154)	(0,00)
89.002	USANA Health Sciences Inc	JPMorgan Chase Bank	(14.620)	(0,00)
(8.052)	Utz Brands Inc	Morgan Stanley	(7.076)	(0,00)
(695)	V2X Inc	Morgan Stanley	(575)	(0,00)
(1.297)	Valaris Ltd	Morgan Stanley	(11)	(0,00)
7.045	Valley National Bancorp	Morgan Stanley	(921)	(0,00)
671	Valvoline Inc	Morgan Stanley	(10)	(0,00)
67	Varonis Systems Inc	Morgan Stanley	(24)	(0,00)
(3.295)	Vaxcyte Inc	Morgan Stanley	(8.349)	(0,00)
(1.900)	Vector Group Ltd	Morgan Stanley	(40)	(0,00)
(2.468)	Veeco Instruments Inc	Morgan Stanley	(1.056)	(0,00)
73.051	Ventas Inc	Morgan Stanley	(7.145)	(0,00)
267	Veracyte Inc	Morgan Stanley	(134)	(0,00)
2.505	Verint Systems Inc	Morgan Stanley	(1.774)	(0,00)
(52.532)	Verisk Analytics Inc	Goldman Sachs International	(441)	(0,00)
(776)	Verisk Analytics Inc	Morgan Stanley	(2.858)	(0,00)
59.762	Verizon Communications Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.647)	(0,00)
63.561	Verizon Communications Inc	Morgan Stanley	(7.307)	(0,00)
8.677	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs International	(21)	(0,00)
320	Vermilion Energy Inc	Morgan Stanley	(54)	(0,00)
(527)	Verra Mobility Corp	Morgan Stanley	(54)	(0,00)
120.816	Vertex Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs International	(22.057)	(0,00)
531.534	Vertex Pharmaceuticals Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.399)	(0,00)
(4.740)	Vertiv Holdings Co Class A	Morgan Stanley	(89)	(0,00)
65.648	VF Corp	Morgan Stanley	(9.627)	(0,00)
25.843	Viasat Inc	Morgan Stanley	(38.393)	(0,00)
(57.685)	Viatris Inc	Morgan Stanley	(18.732)	(0,00)
(1.586)	Viavi Solutions Inc	Morgan Stanley	(317)	(0,00)
9.090	VICI Properties Inc	Morgan Stanley	(831)	(0,00)
5.634	Victoria's Secret & Co	Morgan Stanley	(548)	(0,00)
37	Victory Capital Holdings Inc Class A	Morgan Stanley	(18)	(0,00)
(5.114)	Viking Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(3.533)	(0,00)
(11.040)	Vir Biotechnology Inc	Morgan Stanley	(2.888)	(0,00)
(7.454)	Viridian Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(4.082)	(0,00)
359	Virtu Financial Inc Class A	Morgan Stanley	(30)	(0,00)
496.513	Visa Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(35.933)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
13.644	Visa Inc Class A	Goldman Sachs International	(102)	(0,00)
152.584	Visa Inc Class A	Morgan Stanley	(22.494)	(0,00)
104	Visteon Corp	Morgan Stanley	(289)	(0,00)
(14.779)	Vistra Corp	Morgan Stanley	(9.448)	(0,00)
1.580	Vita Coco Co Inc	Morgan Stanley	(821)	(0,00)
295	Vital Energy Inc	Morgan Stanley	(83)	(0,00)
2.972	Vivid Seats Inc Class A	Morgan Stanley	(168)	(0,00)
1.084.578	Vodacom Group Ltd	Goldman Sachs International	(969)	(0,00)
1.197.381	Vodacom Group Ltd	Morgan Stanley	(157)	(0,00)
38.732	Vornado Realty Trust	Morgan Stanley	(10.073)	(0,00)
69.203	Vulcan Materials Co	Morgan Stanley	(11.322)	(0,00)
(214)	WaFd Inc	Morgan Stanley	(118)	(0,00)
(11.526)	Walgreens Boots Alliance Inc	Morgan Stanley	(4.010)	(0,00)
(88.430)	Walt Disney Co	JPMorgan Chase Bank	(2.980)	(0,00)
(26.878)	Walt Disney Co	Morgan Stanley	(393)	(0,00)
66.353	Warner Bros Discovery Inc	Morgan Stanley	(6.504)	(0,00)
(2.671)	Waste Management Inc	Morgan Stanley	(6.833)	(0,00)
(434)	Waters Corp	Morgan Stanley	(896)	(0,00)
72.732	Watsco Inc	Morgan Stanley	(10.625)	(0,00)
2.974	Wayfair Inc Class A	Morgan Stanley	(48.578)	(0,00)
(6.529)	Wayfair Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(216)	(0,00)
(34.262)	Wayfair Inc Class A	Goldman Sachs International	(1.120)	(0,00)
64.341	WEC Energy Group Inc	Morgan Stanley	(9.343)	(0,00)
3.052	Wells Fargo & Co	Morgan Stanley	(1.177)	(0,00)
68.494	Welltower Inc	Morgan Stanley	(7.669)	(0,00)
(4.200.000)	Wendel SE	BNP Paribas	(305.788)	(0,02)
707.360	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs International	(849)	(0,00)
59.431	Western Digital Corp	Morgan Stanley	(37.037)	(0,00)
(32.459)	Western Union Co	JPMorgan Chase Bank	(3.761)	(0,00)
(84.873)	Western Union Co	Morgan Stanley	(6.009)	(0,00)
(21.742)	Western Union Co	Goldman Sachs International	(547)	(0,00)
(997)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Morgan Stanley	(433)	(0,00)
70.412	Westlake Corp	Morgan Stanley	(10.324)	(0,00)
(11.963)	Weyerhaeuser Co	Morgan Stanley	(5.256)	(0,00)
128	Wheaton Precious Metals Corp	Morgan Stanley	(91)	(0,00)
146	Whirlpool Corp	Morgan Stanley	(142)	(0,00)
65.872	Williams Cos Inc	Morgan Stanley	(3.953)	(0,00)
182.149	Williams Cos Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.040)	(0,00)
690.936	Williams-Sonoma Inc	Morgan Stanley	(358.943)	(0,03)
64.611	Willis Towers Watson Plc	Morgan Stanley	(10.332)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,26 %) (31. Dezember 2022: (1,88 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(110)	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	Morgan Stanley	(1)	(0,00)
1.558	WisdomTree Inc	Morgan Stanley	(316)	(0,00)
79.557	WK Kellogg Co	Goldman Sachs International	(12.209)	(0,00)
205.519	WK Kellogg Co	JPMorgan Chase Bank	(28.346)	(0,00)
66.514	Wolfspeed Inc	Morgan Stanley	(20.271)	(0,00)
902	Wolverine World Wide Inc	Morgan Stanley	(145)	(0,00)
2.737	Woodward Inc	Morgan Stanley	(334)	(0,00)
88.934	Workday Inc Class A	Morgan Stanley	(23.015)	(0,00)
54.386	Workday Inc Class A	Goldman Sachs International	(6.402)	(0,00)
7.576	Workday Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(126)	(0,00)
100	Workiva Inc	Morgan Stanley	(35)	(0,00)
63.469	WP Carey Inc	Morgan Stanley	(14.850)	(0,00)
68.914	WR Berkley Corp	Morgan Stanley	(2.893)	(0,00)
12.134	WW International Inc	Morgan Stanley	(1.877)	(0,00)
(723.886)	Wynn Resorts Ltd	Morgan Stanley	(85.457)	(0,01)
41.042	Xcel Energy Inc	Morgan Stanley	(1.229)	(0,00)
54	Xenia Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	(8)	(0,00)
(4.456)	Xenon Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(22.197)	(0,00)
63.582	Xylem Inc	Morgan Stanley	(18.264)	(0,00)
5.600.000	Yeahka Ltd	Nomura	(120.501)	(0,01)
5.377	Yelp Inc	Morgan Stanley	(2.504)	(0,00)
53	YETI Holdings Inc	Morgan Stanley	(6)	(0,00)
(4.272)	Yum! Brands Inc	Morgan Stanley	(2.578)	(0,00)
(39.584)	Zai Lab Ltd	Goldman Sachs International	(1.984)	(0,00)
(163.140)	Zai Lab Ltd	JPMorgan Chase Bank	(11.058)	(0,00)
309.877	Zalando SE	Goldman Sachs International	(973)	(0,00)
435.014	Zalando SE	JPMorgan Chase Bank	(1.105)	(0,00)
71.121	Zebra Technologies Corp Class A	Morgan Stanley	(17.794)	(0,00)
(3.258)	Zentalis Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(3.670)	(0,00)
76.216	Zillow Group Inc Class C	Morgan Stanley	(23.884)	(0,00)
(43.564)	Zimmer Biomet Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(5.906)	(0,00)
(38.366)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Goldman Sachs International	(3.846)	(0,00)
6.452	ZipRecruiter Inc Class A	Morgan Stanley	(1.875)	(0,00)
51.204	Zoetis Inc	Goldman Sachs International	(11.831)	(0,00)
68.132	ZoomInfo Technologies Inc	Morgan Stanley	(13.984)	(0,00)
15.000.000	ZTO Express Cayman Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20.756)	(0,00)
392.662	Zurich Insurance Group AG	Goldman Sachs International	(28.525)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Differenzkontrakten ∞			**(20.691.238)**	**(1,26)**

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Swaptions (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,02 %))

Anzahl Kontrakte	Fällig-keit	Beschreibung	Gegenpartei	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Put-Swaptions					
(525.000.000) EUR	17.01.2024	EUR Swaption, upon potential exercise of the option, the Portfolio will enter into swap with the notional value of EUR 525,000,000, in which it will pay a rate of 1.00%, and will receive iTraxx EUR S40, strike 1.05%	JPMorgan Chase Bank	(29.043)	(0,00)
Beizulegender Zeitwert aus verkauften Swaptions insgesamt ∞ (Prämie: 213.915 US$)				**(29.043)**	**(0,00)**

Credit-Default-Swap-Kontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,02 %))

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
13.000.000 EUR	20.12.2024	Nomura International Plc	Buying default protection on POSCO Holdings Inc, 2.75%, 15/07/2024	(93.101)	(0,01)
5.800.000 USD	20.12.2026	JPMorgan Chase Bank	Buying default protection on Simon Property Group LP, 2.65%, 15/07/2030	(84.626)	(0,00)
5.000.000 EUR	20.06.2026	BNP Paribas	Buying default protection on Cellnex Telecom SA, 2.36%, 16/01/2024	(591.535)	(0,04)
10.000.000 EUR	20.06.2028	BNP Paribas	Buying default protection on Eni SpA, 1.75%, 18/01/2024	(238.107)	(0,01)
1.250.000.000 JPY	20.06.2025	JPMorgan Chase Bank	Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024	(110.696)	(0,01)
500.000.000 JPY	20.12.2026	Goldman Sachs International	Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024	(75.118)	(0,00)
750.000.000 JPY	20.12.2026	JPMorgan Chase Bank	Buying default protection on ANA Holdings Inc, 1.22%, 06/03/2024	(112.677)	(0,01)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten insgesamt ±				**(1.305.860)**	**(0,08)**

Zinsswap-Kontrakte (0,56) % (31. Dezember 2022: 0,76 %)

Nominalwert		Fällig-keit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)#	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
ZAR	2.000	20.12.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	9,59 %	3M JIBAR	(3)	(0,00)
PLN	10.000	20.09.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	4,83 %	6M WIBOR	(71)	(0,00)
PLN	30.000	15.12.2024	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	1,44 %	6M WIBOR	(290)	(0,00)
ZAR	121.510.000	20.12.2025	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	7,78 %	3M JIBAR	(267)	(0,00)
ZAR	108.820.000	20.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	8,07 %	3M JIBAR	(6.165)	(0,00)
ZAR	36.940.000	20.12.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	9,23 %	3M JIBAR	(14.505)	(0,00)
EUR	1.000.000.000	18.09.2024	Merrill Lynch International	Erhalt	3,70 %	6M €STR	(16.680)	(0,00)
EUR	1.000.000.000	18.09.2024	Merrill Lynch International	Erhalt	3,73 %	6M €STR	(16.680)	(0,00)
ZAR	46.900.000	20.03.2034	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	9,31 %	3M JIBAR	(20.797)	(0,00)
CAD	49.379.000	20.03.2029	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	3,05 %	12M CDOR	(48.414)	(0,00)
USD	7.400.000	18.12.2054	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	3,27 %	1D SOFR	(54.306)	(0,00)
CZK	3.487.500.000	25.04.2024	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	6,55 %	1D PRIBOR	(59.129)	(0,00)
ZAR	234.500.000	20.03.2034	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	9,26 %	3M JIBAR	(62.355)	(0,01)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Zinsswap-Kontrakte (0,56) % (31. Dezember 2022: 0,76 %) (Fortsetzung)

Nominalwert		Fällig-keit	Gegenpartei	Erhalt/(Zahlung)[#]	Fester Zinssatz	Variabler Zinssatz	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
CZK	3.525.000.000	25.04.2024	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	6,32 %	1D PRIBOR	(149.658)	(0,01)
CZK	3.502.500.000	25.04.2024	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	6,30 %	1D PRIBOR	(156.470)	(0,01)
MXN	1.625.000.000	16.12.2026	Chicago Mercantile Exchange[1]	Erhalt	9,18 %	28D MXIBTIIE	(177.291)	(0,01)
USD	11.390.000	18.12.2054	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	3,34 %	1D SOFR	(227.963)	(0,02)
USD	19.800.000	08.09.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	3,75 %	1D SOFR	(270.170)	(0,02)
JPY	2.698.000.000	20.09.2033	LCH Clearnet Ltd[1]	(Zahlung)	0,65 %	12M JPY LIBOR	(350.480)	(0,02)
HUF	1.633.000.000	20.12.2028	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	7,50 %	6M BUBOR	(359.395)	(0,02)
EUR	62.000.000	15.02.2033	Merrill Lynch International	(Zahlung)	2,15 %	1D €STR	(581.877)	(0,04)
SEK	138.592.000	20.03.2034	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	3,16 %	3M STIBOR	(1.019.692)	(0,06)
EUR	1.025.000.000	20.03.2024	Merrill Lynch International	(Zahlung)	3,38 %	3M €STR	(1.518.913)	(0,09)
SEK	233.590.000	20.03.2034	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	3,19 %	3M STIBOR	(1.765.531)	(0,11)
SEK	240.300.000	20.03.2034	LCH Clearnet Ltd[1]	Erhalt	3,37 %	3M STIBOR	(2.212.635)	(0,14)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Zinsswapkontrakten [∞]							**(9.089.737)**	**(0,56)**

[#]Erhalt – der Teilfonds erhält einen variablen Zinssatz und zahlt einen festen Zinssatz.
(Zahlung) – der Teilfonds zahlt einen variablen Zinssatz und erhält einen festen Zinssatz.
[1]Zentral abgewickelter Swap.

Total Return Swap-Kontrakte (0,20 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %))

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
172.027.668 HKD	04.12.2025	5,62[1]	Goldman Sachs Basket GSCBIHKT[2]	(61)	(0,00)
(6.392) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY[4]	(643)	(0,00)
(58.119) USD	06.11.2024	5,02[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUIGV[4]	(1.506)	(0,00)
(58.138) USD	06.11.2024	5,03[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXLK[4]	(2.046)	(0,00)
(57.947) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY[4]	(2.328)	(0,00)
(58.241) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUQQQ[4]	(2.743)	(0,00)
(735.963) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUQQQ[4]	(5.864)	(0,00)
(291.217) USD	06.11.2024	5,08[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXLV[4]	(7.901)	(0,00)
(179.512) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY[4]	(8.349)	(0,00)
(562.570) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXLP[4]	(9.177)	(0,00)
(945.631) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSABHLTH[4]	(11.386)	(0,00)
(396.552) USD	19.07.2024	4,53[3]	Morgan Stanley Basket MSCBSBTU[4]	(16.414)	(0,00)
(212.865) USD	06.11.2024	5,03[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXLK[4]	(16.685)	(0,00)
(507.899) USD	06.11.2024	5,08[3]	Morgan Stanley Basket MSXXSTAP[4]	(17.244)	(0,00)
(196.090) USD	06.11.2024	5,76[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM[4]	(18.616)	(0,00)
(135.934) USD	06.11.2024	4,99[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUSMH[4]	(22.509)	(0,00)
(274.381) USD	06.11.2024	5,76[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXBI[4]	(26.812)	(0,00)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Total Return Swap-Kontrakte (0,20 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %)) (Fortsetzung)

Nominalwert	Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
(612.240) USD	06.11.2024	5,76[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM[4]	(30.573)	(0,00)
(356.635) USD	06.11.2024	5,03[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXLC[4]	(31.710)	(0,00)
(363.511) EUR	12.11.2025	3,38[5]	Morgan Stanley Basket MSABESHQ[4]	(33.777)	(0,00)
(902.075) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY[4]	(34.194)	(0,00)
(560.375) EUR	19.08.2024	3,60[6]	JPMorgan Basket JPAYMCPH[7]	(34.530)	(0,00)
(667.431) EUR	12.06.2024	3,60[6]	JPMorgan Basket JPECND[7]	(42.937)	(0,00)
(490.834) USD	05.03.2025	4,51[3]	Morgan Stanley Basket MSACWLUP[4]	(49.034)	(0,00)
(548.466) USD	06.11.2024	5,76[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM[4]	(49.682)	(0,00)
1.521.138 USD	09.02.2024	5,13[8]	JPMorgan Basket JPSOBRKE[7]	(51.944)	(0,00)
(115.207) USD	21.03.2024	5,58[3]	Goldman Sachs Basket GSUCPSL2[2]	(57.981)	(0,00)
(978.287) USD	06.11.2024	5,02[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXRT[4]	(61.831)	(0,01)
(623.577) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUQQQ[4]	(65.398)	(0,01)
(508.787) USD	06.11.2024	5,02[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXRT[4]	(65.731)	(0,01)
(653.544) USD	06.11.2024	5,03[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXLY[4]	(70.092)	(0,01)
(801.593) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY[4]	(82.262)	(0,01)
(776.610) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUQQQ[4]	(86.023)	(0,01)
(573.836) USD	06.11.2024	5,02[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXRT[4]	(111.862)	(0,01)
(1.041.706) USD	06.11.2024	5,03[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXLK[4]	(127.315)	(0,01)
(1.238.485) USD	06.11.2024	5,03[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXLC[4]	(138.019)	(0,01)
(1.358.074) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY[4]	(160.260)	(0,01)
(855.523) USD	06.11.2024	5,76[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUIWM[4]	(162.113)	(0,01)
(1.984.944) USD	06.11.2024	5,11[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUSPY[4]	(196.557)	(0,01)
35.000.160 HKD	22.03.2024	5,62[1]	JPMorgan Basket JPSOCINS[7]	(260.639)	(0,02)
(1.655.868) USD	06.11.2024	5,76[3]	Morgan Stanley Basket MSNBUXBI[4]	(388.192)	(0,03)
(1.648.509) USD	06.11.2024	5,06[3]	Morgan Stanley Basket MSABSMBP[4]	(458.226)	(0,03)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten [∞]				**(3.021.166)**	**(0,20)**

[1] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der Ein-Monats-HIBOR.

[2] Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

[3] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-FEDEF.

[4] Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist Morgan Stanley.

[5] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Monat-EURIBOR.

[6] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-ESTR.

[7] Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

[8] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist der 1-Tag-SOFR.

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Inflation-Swap-Kontrakte (0,03 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

Vega Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenz-obligation	Variance-Ausübungssatz	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
400.000 USD	20.12.2024	UBS	UBS 38 Names US Basket	Verschiedene	(12.744)	(0,00)
250.000 EUR	20.06.2025	BNP Paribas	FTSE MIB Index vs Euro Stoxx 50 Index	34,0 / 33,0	(22.755)	(0,00)
750.000 USD	19.12.2025	BNP Paribas	FTSE MIB Index vs S&P 500 Index	24,60 / 27,95	(23.344)	(0,00)
300.000 USD	20.12.2024	UBS	UBS 24 Names US Basket	Verschiedene	(37.161)	(0,00)
125.000 USD	21.06.2024	Goldman Sachs International	GS 34 Names Global Basket	Verschiedene	(418.672)	(0,03)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Inflation-Swap-Kontrakten °°					**(514.676)**	**(0,03)**

Volatility-Swap-Kontrakte (0,56 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %))

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation[1]	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
3.750.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 20 Names EU Basket	(838)	(0,00)
15.000.000 USD	17.01.2025	BofA Securities	BAML 17 Names US Basket	(6.694)	(0,00)
15.000.000 USD	17.01.2025	BofA Securities	BAML 14 Names US Basket	(20.978)	(0,00)
9.513.000 EUR	21.06.2024	Société Générale	SG 15 Names Global Basket	(29.825)	(0,00)
40.000.000 USD	17.01.2025	Citibank NA	CITI 24 Names US Basket	(42.419)	(0,00)
14.830.000 USD	20.06.2025	Morgan Stanley	CITI 31 Names Global Basket	(49.835)	(0,00)
35.000.000 EUR	20.12.2024	Société Générale	SG 12 Names EU Basket	(50.261)	(0,00)
30.000.000 USD	20.06.2025	Nomura	Nomura 20 Names Global Basket	(62.138)	(0,00)
10.000.000 EUR	20.12.2024	BofA Securities	BAML 12 Names EU Basket	(77.915)	(0,01)
1.000.000 EUR	19.01.2024	BNP	BNP 5 Names EU Basket	(24.043)	(0,00)
20.000.000 USD	17.01.2025	BNP	BNP 13 Names US Basket	(97.257)	(0,01)
12.500.000 USD	20.06.2025	BofA Securities	BAML 19 Names US Basket	(98.585)	(0,01)
20.000.000 USD	20.12.2024	UBS	UBS 10 Names US Geo Basket	(105.892)	(0,01)
20.000.000 USD	17.01.2025	UBS	UBS 14 Names US Vanilla Basket	(116.406)	(0,01)
10.000.000 EUR	20.12.2024	Morgan Stanley	CITI 15 Names US Basket	(142.429)	(0,01)
20.000.000 USD	20.06.2025	BNP	BNP 31 Names Global Basket	(149.796)	(0,01)
12.500.000 USD	17.01.2025	Morgan Stanley	CITI 24 Names US Basket	(155.036)	(0,01)
15.000.000 USD	17.01.2025	BofA Securities	BAML 18 Names US Basket	(179.167)	(0,01)
13.500.000 EUR	17.01.2025	BNP	BNP 19 Names Global Basket	(184.865)	(0,01)
20.000.000 USD	17.01.2025	Morgan Stanley	CITI 22 Names US Basket	(186.155)	(0,01)
30.000.000 EUR	20.12.2024	BNP	BNP 10 Names EU Basket	(196.580)	(0,01)
21.551.100 EUR	20.12.2024	Société Générale	SG 15 Names Global Basket	(240.445)	(0,01)
17.500.000 USD	17.01.2025	Morgan Stanley	CITI 27 Names US Basket	(247.773)	(0,02)
20.000.000 USD	17.01.2025	Morgan Stanley	CITI 20 Names US Basket	(265.585)	(0,02)
20.000.000 USD	17.01.2025	Morgan Stanley	CITI 31 Names US Basket	(267.544)	(0,02)
22.500.000 EUR	17.01.2025	BNP	BNP 38 Names Global Basket	(291.672)	(0,02)
20.000.000 USD	17.01.2025	JPMorgan Chase Bank	JPMorgan Chase Bank 16 Names US Basket	(298.216)	(0,02)
20.000.000 USD	17.01.2025	BofA Securities	BAML 27 Names US Basket	(355.578)	(0,02)

Uncorrelated Strategies - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Volatility-Swap-Kontrakte (0,56 %) (31. Dezember 2022: (0,14 %)) (Fortsetzung)

Nominalwert	Datum der Schließung	Gegenpartei	Referenzobligation[1]	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
30.000.000 USD	17.01.2025	BofA Securities	BAML 22 Names US Basket	(385.517)	(0,02)
20.000.000 USD	17.01.2025	BofA Securities	BAML 19 Names US Basket	(402.675)	(0,02)
40.000.000 USD	17.01.2025	UBS	UBS 24 Names US Basket	(419.508)	(0,03)
20.000.000 USD	17.01.2025	Morgan Stanley	CITI 22 Names US Basket	(475.225)	(0,03)
50.000.000 USD	17.01.2025	Citibank NA	CITI 24 Names US Basket	(479.523)	(0,03)
20.000.000 USD	17.01.2025	Morgan Stanley	CITI 26 Names US Basket	(483.775)	(0,03)
50.010.000 USD	20.06.2025	Nomura	Nomura 31 Names Global Basket	(508.167)	(0,03)
23.500.000 EUR	17.01.2025	BNP	BNP 43 Names EU Basket	(534.662)	(0,03)
30.000.000 USD	17.01.2025	Morgan Stanley	CITI 16 Names US Basket	(585.396)	(0,04)
40.000.000 USD	17.01.2025	UBS	UBS 29 Names US Basket	(693.114)	(0,05)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Volatility-Swap-Kontrakten ∞				**(8.911.489)**	**(0,56)**

[1]Die Volatilitäten lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Swaps.

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(499.958.213)**	**(30,73)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**976.303.958**	**60,02**
Sonstiges Nettovermögen	**650.397.463**	**39,98**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**1.626.701.421**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	143.619.130	6,29
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	801.699.122	35,09
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	8.000	0,00
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(15.248.785)	(0,67)
∞	Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate)	46.226.491	2,02
Anlagen insgesamt		**976.303.958**	**42,73**

US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 93,23 % (31. Dezember 2022: 85,83 %)		
	US-Dollar		
5.596	AbbVie Inc	867.212	1,76
1.604	Adobe Inc	956.946	1,94
16.859	Alphabet Inc Class A	2.355.034	4,79
20.248	Amazon.com Inc	3.076.481	6,25
4.246	Analog Devices Inc	843.086	1,71
10.145	Apple Inc	1.953.217	3,97
1.681	Atlassian Corp Class A	399.843	0,81
2.541	Avery Dennison Corp	513.688	1,04
10.521	Boston Scientific Corp	608.219	1,24
11.301	Brookfield Asset Management Ltd Class A	453.961	0,92
3.457	CDW Corp	785.845	1,60
23.937	Chewy Inc Class A	565.631	1,15
3.304	CME Group Inc Class A	695.822	1,41
1.067	Costco Wholesale Corp	704.305	1,43
5.342	Dollar Tree Inc	758.831	1,54
4.092	Equifax Inc	1.011.911	2,06
693	Home Depot Inc	240.159	0,49
2.110	Intuit Inc	1.318.813	2,68
3.404	Johnson & Johnson	533.543	1,08
23.464	Keurig Dr Pepper Inc	781.820	1,59
2.809	Mastercard Inc Class A	1.198.067	2,44
25.230	Match Group Inc	920.895	1,87
3.635	McDonald's Corp	1.077.814	2,19
5.631	Meta Platforms Inc Class A	1.993.149	4,05
11.573	Microsoft Corp	4.351.911	8,85
1.892	Netflix Inc	921.177	1,87
14.396	NextEra Energy Inc	874.413	1,78
3.287	NIKE Inc Class B	356.870	0,73
2.751	NVIDIA Corp	1.362.350	2,77
711	Oddity Tech Ltd Class A	33.083	0,07
5.849	Okta Inc Class A	529.510	1,08
18.811	Paycor HCM Inc	406.129	0,83
3.895	Progressive Corp	620.396	1,26
1.913	S&P Global Inc	842.715	1,71
6.264	Salesforce Inc	1.648.309	3,35
1.343	ServiceNow Inc	948.816	1,93
14.673	Sweetgreen Inc Class A	165.805	0,34
3.996	TE Connectivity Ltd	561.438	1,14
1.515	Thermo Fisher Scientific Inc	804.147	1,63

US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Aktien 93,23 % (31. Dezember 2022: 85,83 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
11.368	TJX Cos Inc	1.066.432	2,17
2.798	Union Pacific Corp	687.245	1,40
2.937	UnitedHealth Group Inc	1.546.242	3,14
4.434	Visa Inc Class A	1.154.392	2,35
3.697	Walmart Inc	582.832	1,18
3.906	Waste Management Inc	699.565	1,42
3.965	Workday Inc Class A	1.094.578	2,22
	Aktien insgesamt *	**45.872.647**	**93,23**
	Anlagen insgesamt	**45.872.647**	**93,23**

Devisenterminkontrakte 2,55 % (31. Dezember 2022: 6,86 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettovermögens
Abgesicherte Klassen JPY						
427.231.585 ¥	2.933.786 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	11	103.962	0,21
3.871.772.129 ¥	26.414.867 US$	18.01.2024	UBS AG	10	1.114.639	2,27
148.937.607 ¥	1.024.102 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	5	34.891	0,07
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**1.253.492**	**2,55**

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**47.126.139**	**95,78**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,24 %) (31. Dezember 2022: (1,74 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
Abgesicherte Klassen JPY						
25.388.163 ¥	180.587 US$	18.01.2024	Royal Bank of Canada	1	(69)	(0,00)
1.028.930 US$	149.667.542 ¥	18.01.2024	Royal Bank of Canada	4	(35.254)	(0,07)
1.069.165 US$	156.974.027 ¥	18.01.2024	UBS AG	3	(46.969)	(0,10)
720.916 US$	106.547.535 ¥	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(36.671)	(0,07)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(118.963)**	**(0,24)**

US Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(118.963)**	**(0,24)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**47.007.176**	**95,54**
Sonstiges Nettovermögen	**2.194.973**	**4,46**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**49.202.149**	**100,00**

Portfolioanalyse		**US$**	**% des Gesamtvermögens**
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	45.872.647	92,21
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	1.134.529	2,28
Anlagen insgesamt		**47.007.176**	**94,49**

US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Staatsanleihen 90,98 % (31. Dezember 2022: 92,92 %)				
	US-Dollar				
86.400.000	United States Treasury Note/Bond	0,25 %	15.03.2024	85.540.224	11,73
90.000.000	United States Treasury Note/Bond	0,25 %	15.06.2024	88.036.705	12,07
90.000.000	United States Treasury Note/Bond	0,38 %	15.09.2024	87.162.353	11,96
87.100.000	United States Treasury Note/Bond	1,00 %	15.12.2024	83.997.550	11,52
80.700.000	United States Treasury Note/Bond	1,75 %	15.03.2025	77.988.985	10,70
82.300.000	United States Treasury Note/Bond	2,88 %	15.06.2025	80.446.643	11,03
82.300.000	United States Treasury Note/Bond	3,50 %	15.09.2025	81.099.256	11,12
79.500.000	United States Treasury Note/Bond	4,00 %	15.12.2025	79.085.420	10,85
	Staatsanleihen insgesamt *			**663.357.136**	**90,98**
	Anlagen insgesamt			**663.357.136**	**90,98**

Devisenterminkontrakte 1,67 % (31. Dezember 2022: 2,44 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
235.935 €	253.199 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	7.589	0,00
10.876.779 €	11.621.373 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	32	401.136	0,06
67.171 US$	60.448 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	355	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
2.066.375 £	2.553.703 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	80.743	0,01
249.724.445 £	306.742.430 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	64	11.634.206	1,60
315.939 US$	247.436 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	479	0,00
Abgesicherte Klassen SGD						
179.581 SGD	132.180 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	8	4.058	0,00
16.043 SGD	11.933 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	12	239	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**12.128.805**	**1,67**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**675.485.941**	**92,65**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2022: (0,20 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
102.217 €	113.360 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(376)	(0,00)
240.403 US$	226.022 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(9.428)	(0,00)
995.101 US$	923.316 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	53	(25.475)	(0,00)

US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,07 %) (31. Dezember 2022: (0,20 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
Abgesicherte Klassen GBP						
2.066.220 £	2.642.933 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(8.685)	(0,00)
2.631.658 £	3.358.922 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	(3.790)	(0,00)
5.311.781 US$	4.370.234 £	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(259.882)	(0,04)
9.365.948 US$	7.527.011 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	50	(230.328)	(0,03)
Abgesicherte Klassen SGD						
6.587 SGD	4.997 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(0)	(0,00)
3.866 US$	5.281 SGD	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(140)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞]					**(538.104)**	**(0,07)**

Verkaufte Optionskontrakte (0,72 %) (31. Dezember 2022: (1,90 %))

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
Verkaufsoptionen				
(2)	05.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,605.00	(140)	(0,00)
(71)	12.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,635.00	(38.340)	(0,00)
(69)	12.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,645.00	(42.090)	(0,01)
(85)	12.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,710.00	(121.975)	(0,02)
(56)	12.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,725.00	(98.560)	(0,01)
(23)	12.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,740.00	(49.795)	(0,01)
(3)	05.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,760.00	(5.130)	(0,00)
(183)	05.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,770.00	(393.450)	(0,05)
(46)	05.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,780.00	(119.370)	(0,02)
(16)	26.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,780.00	(79.280)	(0,01)
(26)	05.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,785.00	(75.140)	(0,01)
(332)	26.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,785.00	(1.724.740)	(0,24)
(11)	02.02.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,785.00	(67.430)	(0,01)
(91)	05.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,790.00	(285.285)	(0,04)
(12)	05.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,795.00	(41.160)	(0,01)
(7)	12.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,795.00	(30.800)	(0,00)
(15)	26.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,795.00	(84.300)	(0,01)
(6)	05.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,800.00	(23.700)	(0,00)
(69)	12.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,800.00	(334.650)	(0,05)
(13)	26.01.2024	CBOE S&P 500 Index, Strike Price $4,800.00	(78.390)	(0,01)
(4)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,735.00	(10.440)	(0,00)
(23)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,740.00	(63.480)	(0,01)
(40)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,760.00	(137.600)	(0,02)
(21)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,770.00	(79.590)	(0,01)
(176)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,780.00	(744.480)	(0,10)

US Equity Index PutWrite - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (0,72 %) (31. Dezember 2022: (1,90 %)) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen (Fortsetzung)				
(112)	19.01.2024	S&P 500 Index, Strike Price $4,790.00	(522.480)	(0,07)
Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt ± (Prämie: 7.471.523 US$)			**(5.251.795)**	**(0,72)**

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(5.789.899)**	**(0,79)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**669.696.042**	**91,86**
Sonstiges Nettovermögen	**59.401.958**	**8,14**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**729.098.000**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	663.357.136	90,05
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(5.251.795)	(0,71)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	11.590.701	1,57
Anlagen insgesamt		**669.696.042**	**90,91**

US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 95,28 % (31. Dezember 2022: 95,51 %)		
	US-Dollar		
117.656	3M Co	12.862.154	0,66
345.761	Agnico Eagle Mines Ltd	18.964.991	0,98
72.115	Air Products & Chemicals Inc	19.745.087	1,02
469.680	American Electric Power Co Inc	38.147.410	1,97
57.874	American International Group Inc	3.920.963	0,20
63.757	Amgen Inc	18.363.291	0,95
76.980	Applied Materials Inc	12.476.149	0,64
1.104.636	AT&T Inc	18.535.792	0,96
626.489	Bank of America Corp	21.093.885	1,09
159.125	Becton Dickinson & Co	38.799.449	2,00
139.714	Berkshire Hathaway Inc Class B	49.830.395	2,57
258.289	Bristol-Myers Squibb Co	13.252.809	0,68
21.063	CBRE Group Inc Class A	1.960.755	0,10
833.666	CenterPoint Energy Inc	23.817.838	1,23
560.152	Citigroup Inc	28.814.219	1,49
126.520	CME Group Inc Class A	26.645.112	1,37
206.541	Colgate-Palmolive Co	16.463.383	0,85
420.672	Comcast Corp Class A	18.446.467	0,95
68.938	ConocoPhillips	8.001.634	0,41
54.805	Constellation Brands Inc Class A	13.249.109	0,68
278.278	CVS Health Corp	21.972.831	1,13
98.533	Danaher Corp	22.794.624	1,18
135.701	Devon Energy Corp	6.147.255	0,32
224.901	Dominion Energy Inc	10.570.347	0,54
552.679	DTE Energy Co	60.938.386	3,14
766.589	Duke Energy Corp	74.389.796	3,84
30.708	Elevance Health Inc	14.480.664	0,75
1.482.951	Exelon Corp	53.237.941	2,74
533.271	Exxon Mobil Corp	53.316.435	2,75
5.448	Fastenal Co	352.867	0,02
156.435	FirstEnergy Corp	5.734.907	0,30
162.876	Franco-Nevada Corp	18.048.289	0,93
665.557	Freeport-McMoRan Inc	28.332.761	1,46
578.307	Gilead Sciences Inc	46.848.650	2,42
30.811	Intercontinental Exchange Inc	3.957.057	0,20
139.497	International Business Machines Corp	22.814.734	1,18
456.631	Johnson & Johnson	71.572.343	3,69

US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 95,28 % (31. Dezember 2022: 95,51 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
313.669	JPMorgan Chase & Co	53.355.097	2,75
329.383	Kenvue Inc	7.091.616	0,37
641.260	Kroger Co	29.311.995	1,51
461.370	Las Vegas Sands Corp	22.704.018	1,17
25.729	Lockheed Martin Corp	11.661.412	0,60
574.710	Merck & Co Inc	62.654.884	3,23
815.400	Mondelez International Inc Class A	59.059.422	3,05
118.812	Mosaic Co	4.245.153	0,22
1.022.356	Newmont Corp	42.315.315	2,18
59.175	NIKE Inc Class B	6.424.630	0,33
34.248	Nucor Corp	5.960.522	0,31
1.825.832	Pfizer Inc	52.565.703	2,71
237.949	Philip Morris International Inc	22.386.242	1,15
338.196	PNC Financial Services Group Inc	52.369.651	2,70
544.896	Procter & Gamble Co	79.849.060	4,12
333.271	Public Service Enterprise Group Inc	20.379.522	1,05
13.297	QUALCOMM Inc	1.923.145	0,10
665.997	Rio Tinto Plc ADR	49.590.137	2,56
7.471	S&P Global Inc	3.291.125	0,17
825.476	Sempra	61.687.821	3,18
15.516	Sherwin-Williams Co	4.839.440	0,25
213.620	Southern Copper Corp	18.386.273	0,95
98.172	Stryker Corp	29.398.587	1,52
42.980	T-Mobile US Inc	6.890.983	0,35
356.245	Truist Financial Corp	13.152.565	0,68
57.912	UnitedHealth Group Inc	30.488.931	1,57
760.909	Verizon Communications Inc	28.686.269	1,48
333.823	Walmart Inc	52.627.196	2,71
66.000	Waste Management Inc	11.820.600	0,61
363.710	Wells Fargo & Co	17.901.806	0,92
542.532	Wheaton Precious Metals Corp	26.768.529	1,38
411.084	Williams Cos Inc	14.318.056	0,74
202.702	Zimmer Biomet Holdings Inc	24.668.833	1,27
	Aktien insgesamt *	**1.847.675.317**	**95,28**

US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Immobilienaktiengesellschaften 0,20 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)		
	US-Dollar		
4.844	Equinix Inc	3.901.309	0,20
	Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *	**3.901.309**	**0,20**
	Anlagen insgesamt	**1.851.576.626**	**95,48**

Devisenterminkontrakte 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,06 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Netto-vermögens
Abgesicherte Klassen EUR						
26.290.661 €	28.035.510 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	8	1.024.546	0,05
3.536.840 €	3.832.644 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	40	76.760	0,01
41.155 US$	37.030 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	5	223	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
179.876 £	221.123 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	6	8.203	0,00
205.760 £	253.047 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	14	9.280	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**1.119.012**	**0,06**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**1.852.695.638**	**95,54**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2022: (0,01 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
Abgesicherte Klassen EUR						
220.591 €	244.392 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(564)	(0,00)
1.574.949 US$	1.456.862 €	18.01.2024	Standard Chartered Bank	7	(35.374)	(0,00)
2.491.567 US$	2.324.866 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	79	(78.190)	(0,01)
Abgesicherte Klassen GBP						
7.164 £	9.164 US$	18.01.2024	Standard Chartered Bank	1	(30)	(0,00)
15.573 US$	12.598 £	18.01.2024	Standard Chartered Bank	5	(489)	(0,00)
35.085 US$	28.445 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	8	(1.180)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(115.827)**	**(0,01)**

US Large Cap Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(115.827)**	**(0,01)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**1.852.579.811**	**95,53**
Sonstiges Nettovermögen	**86.610.567**	**4,47**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**1.939.190.378**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	1.851.576.626	91,92
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	1.003.185	0,05
Anlagen insgesamt		**1.852.579.811**	**91,97**

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 85,22 % (31. Dezember 2022: 71,33 %)		
	Euro		
10.679	Airbus SE*	1.648.923	0,84
	Euro insgesamt	**1.648.923**	**0,84**
	US-Dollar		
7.805	AbbVie Inc*	1.209.541	0,62
6.270	Adobe Inc*	3.740.682	1,91
38.327	Alphabet Inc Class A*	5.353.899	2,74
43.026	Amazon.com Inc*	6.537.370	3,34
13.817	Amphenol Corp Class A*	1.369.679	0,70
9.216	Analog Devices Inc*	1.829.929	0,94
25.712	Apple Inc*	4.950.331	2,53
7.577	Asbury Automotive Group Inc*	1.704.598	0,87
10.985	Ashland Inc*	926.145	0,47
1.461	ASML Holding NV*	1.105.860	0,57
3.716	Atlassian Corp Class A*	883.888	0,45
9.639	Avery Dennison Corp*	1.948.620	1,00
5.418	Boeing Co*	1.412.256	0,72
32.374	Boston Scientific Corp*	1.871.541	0,96
43.258	Brookfield Corp*	1.735.511	0,89
6.972	CDW Corp*	1.584.875	0,81
102.578	Celebration Bidco Holdings LLC**	1.538.670	0,79
89.489	CenterPoint Energy Inc*	2.556.701	1,31
21.432	Chevron Corp*	3.196.797	1,64
94.471	Chewy Inc Class A*	2.232.350	1,14
13.284	CME Group Inc Class A*	2.797.610	1,43
1.759	Costco Wholesale Corp*	1.161.081	0,59
23.073	Dollar Tree Inc*	3.277.520	1,68
12.228	Equifax Inc*	3.023.862	1,55
35.393	European Wax Center Inc Class A*	480.991	0,25
17.684	First Watch Restaurant Group Inc*	355.448	0,18
44.424	FirstEnergy Corp*	1.628.584	0,83
3.614	Home Depot Inc*	1.252.432	0,64
1.731	Humana Inc*	792.469	0,41
3.487	Illumina Inc*	485.530	0,25
3.748	Intuit Inc*	2.342.612	1,20
14.415	Jacobs Solutions Inc*	1.871.067	0,96
8.642	Johnson & Johnson*	1.354.547	0,69
18.700	JPMorgan Chase & Co*	3.180.870	1,63
50.887	Kenvue Inc*	1.095.597	0,56
120.344	Keurig Dr Pepper Inc*	4.009.862	2,05

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 85,22 % (31. Dezember 2022: 71,33 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
1.428	Klaviyo Inc Class A*	39.670	0,02
2.500	L3Harris Technologies Inc*	526.550	0,27
5.977	Lamb Weston Holdings Inc*	646.054	0,33
3.169	Marriott International Inc Class A*	714.641	0,37
7.078	Mastercard Inc Class A*	3.018.838	1,54
84.663	Match Group Inc*	3.090.199	1,58
16.879	McDonald's Corp*	5.004.792	2,56
14.429	Meta Platforms Inc Class A*	5.107.289	2,61
23.061	Microsoft Corp*	8.671.858	4,44
20.459	Mondelez International Inc Class A*	1.481.845	0,76
4.283	Netflix Inc*	2.085.307	1,07
58.002	NextEra Energy Inc*	3.523.041	1,80
8.300	NIKE Inc Class B*	901.131	0,46
30.687	nVent Electric Plc*	1.813.295	0,93
3.139	NVIDIA Corp*	1.554.496	0,80
5.738	Oddity Tech Ltd Class A*	266.989	0,14
18.680	Okta Inc Class A*	1.691.100	0,87
70.264	Paramount Global Class B*	1.039.205	0,53
77.520	Paycor HCM Inc*	1.673.657	0,86
6.788	Procter & Gamble Co*	994.714	0,51
15.646	Progressive Corp*	2.492.095	1,27
89.080	Repay Holdings Corp Class A*	760.743	0,39
6.719	S&P Global Inc*	2.959.854	1,51
19.930	Salesforce Inc*	5.244.380	2,68
2.831	ServiceNow Inc*	2.000.073	1,02
10.742	Splunk Inc*	1.636.544	0,84
73.046	Sweetgreen Inc Class A*	825.420	0,42
8.405	TE Connectivity Ltd*	1.180.902	0,60
3.405	Thermo Fisher Scientific Inc*	1.807.340	0,92
45.502	TJX Cos Inc*	4.268.543	2,18
17.047	Uber Technologies Inc*	1.049.584	0,54
16.479	Union Pacific Corp*	4.047.572	2,07
7.063	UnitedHealth Group Inc*	3.718.458	1,90
11.437	Visa Inc Class A*	2.977.623	1,52
11.987	Walmart Inc*	1.889.751	0,97
11.997	Waste Management Inc*	2.148.663	1,10
33.165	WEC Energy Group Inc*	2.791.498	1,43
9.025	Workday Inc Class A*	2.491.441	1,27
	US-Dollar insgesamt	**164.934.480**	**84,38**
	Aktien insgesamt	**166.583.403**	**85,22**

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Immobilienaktiengesellschaften 1,81 % (31. Dezember 2022: 0,79 %)		
	US-Dollar		
2.104	Equinix Inc	1.694.541	0,87
7.251	SBA Communications Corp Class A	1.839.506	0,94
	Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *	**3.534.047**	**1,81**

Kapitalbetrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeitsdatum	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Unternehmensanleihen 3,92 % (31. Dezember 2022: 3,79 %)				
	US-Dollar				
404.000	Alphabet Inc**	2,25 %	15.08.2060	250.278	0,13
690.000	Amazon.com Inc**	3,25 %	12.05.2061	506.934	0,26
1.095.119	Anagram Holdings LLC/Anagram International Inc**	10,00 %	15.08.2026	0	0,00
819.000	Apple Inc**	2,85 %	05.08.2061	560.472	0,29
250.000	CDW LLC/CDW Finance Corp**	2,67 %	01.12.2026	234.135	0,12
550.000	Florida Power & Light Co*	2,88 %	04.12.2051	381.948	0,20
943.000	Johnson & Johnson*	2,45 %	01.09.2060	606.631	0,31
138.000	Mastercard Inc*	2,95 %	15.03.2051	102.499	0,05
954.000	Meta Platforms Inc**	4,65 %	15.08.2062	889.197	0,45
253.000	Meta Platforms Inc**	5,60 %	15.05.2053	274.413	0,14
18.000	Meta Platforms Inc**	5,75 %	15.05.2063	19.728	0,01
939.000	Microsoft Corp**	2,50 %	15.09.2050	634.977	0,32
520.000	Microsoft Corp**	2,68 %	01.06.2060	347.634	0,18
125.000	nVent Finance Sarl**	4,55 %	15.04.2028	121.544	0,06
455.000	Oracle Corp*	3,85 %	01.04.2060	330.361	0,17
45.000	Oracle Corp*	6,90 %	09.11.2052	52.868	0,03
545.000	PepsiCo Inc**	2,75 %	21.10.2051	387.717	0,20
125.000	SBA Communications Corp**	3,88 %	15.02.2027	120.125	0,06
410.000	Uber Technologies Inc**	8,00 %	01.11.2026	417.891	0,21
564.000	UnitedHealth Group Inc*	3,13 %	15.05.2060	401.197	0,20
185.000	UnitedHealth Group Inc*	5,05 %	15.04.2053	187.060	0,10
943.000	Walmart Inc*	2,65 %	22.09.2051	658.095	0,34
190.000	Walmart Inc*	4,50 %	15.04.2053	184.831	0,09
	Unternehmensanleihen insgesamt			**7.670.535**	**3,92**
	Mittelfristige Schuldverschreibungen 0,25 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
	US-Dollar				
487.831	Celebration Bidco LLC	15,50 %	29.12.2028	487.831	0,25
	Mittelfristige Schuldverschreibungen insgesamt †			**487.831**	**0,25**
	Anlagen insgesamt			**178.275.816**	**91,20**

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 1,68 % (31. Dezember 2022: 3,02 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
1.409.287 €	1.525.145 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	32.593	0,02
41.429.286 €	44.171.958 US$	18.01.2024	UBS AG	8	1.621.390	0,83
38.857.624 €	41.389.210 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	26	1.561.584	0,80
187.347 US$	168.576 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	1.013	0,00
Abgesicherte Klassen GBP						
20.304 £	25.015 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	871	0,00
6.979 £	8.582 US$	18.01.2024	UBS AG	1	316	0,00
1.543.817 £	1.909.718 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	13	58.513	0,03
Abgesicherte Klassen SGD						
312.630 SGD	230.089 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	7.087	0,00
1.188 SGD	887 US$	18.01.2024	UBS AG	1	14	0,00
17.726 SGD	13.126 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	13	323	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞]					**3.283.704**	**1,68**

Differenzkontrakte 0,32 % (31. Dezember 2022: 1,43 %)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
315.480	Adyen NV	JPMorgan Chase Bank	8.574	0,01
201.218	Agilon Health Inc	Goldman Sachs International	56.127	0,03
391.490	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Goldman Sachs International	14.339	0,01
257.548	Campbell Soup Co	Goldman Sachs International	53.873	0,03
945.318	CarMax Inc	Goldman Sachs International	77.413	0,04
179.017	Conagra Brands Inc	JPMorgan Chase Bank	4.234	0,00
344.323	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs International	41.750	0,02
100.638	Estee Lauder Companies Class A	Goldman Sachs International	2.014	0,00
278.313	Exelon Corp	Goldman Sachs International	2.150	0,00
80.679	Figs Inc Class A	Goldman Sachs International	8	0,00
89.115	Floor & Decor Holdings Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	225	0,00
27.560	Fubotv Inc	JPMorgan Chase Bank	2.102	0,00
334.155	Grocery Outlet Holding Corp	Goldman Sachs International	45.325	0,02
17.294	Grocery Outlet Holding Corp	JPMorgan Chase Bank	1.069	0,00
561.080	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs International	72.970	0,04
212.917	Joby Aviation Inc	JPMorgan Chase Bank	7.980	0,01
622.509	Lamar Advertising Co Class A	JPMorgan Chase Bank	6.726	0,00
103.859	Lemonade Inc	Goldman Sachs International	5.423	0,00
263.979	Maplebear Inc	Citibank NA	59.547	0,03
500.873	Paycom Software Inc	Goldman Sachs International	84.907	0,04
100.717	Renaissancere Holdings Ltd	Goldman Sachs International	11.797	0,01
224.962	Renaissancere Holdings Ltd	JPMorgan Chase Bank	127	0,00
336.990	Southern Co	Goldman Sachs International	1.205	0,00

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte 0,32 % (31. Dezember 2022: 1,43 %) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
351.256	Southern Co	JPMorgan Chase Bank	3.721	0,00
369.155	Tesla Inc	JPMorgan Chase Bank	7.339	0,00
174.233	Trade Desk Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	6.909	0,00
102.012	Vita Coco Co Inc	JPMorgan Chase Bank	1.909	0,00
638.340	Warner Bros Discovery Inc	Goldman Sachs International	34.650	0,02
221.668	World Acceptance Corp	JPMorgan Chase Bank	10.016	0,01
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Differenzkontrakten ∞			**624.429**	**0,32**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**182.183.949**	**93,20**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,18 %) (31. Dezember 2022: (0,37 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen EUR						
368.698 €	407.986 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(450)	(0,00)
2.159.888 US$	2.026.523 €	18.01.2024	UBS AG	1	(80.104)	(0,04)
9.791.741 US$	9.092.564 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	88	(258.616)	(0,14)
Abgesicherte Klassen GBP						
8.323 £	10.613 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(2)	(0,00)
10.278 US$	8.098 £	18.01.2024	UBS AG	1	(46)	(0,00)
8.024 US$	6.622 £	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(419)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SGD						
890 SGD	675 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(0)	(0,00)
92.726 US$	125.996 SGD	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(2.861)	(0,00)
740 US$	985 SGD	18.01.2024	UBS AG	1	(7)	(0,00)
22.000 US$	29.481 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	12	(365)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(342.870)**	**(0,18)**

Futures-Kontrakte (0,51 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Nicht realisierter Verlust US$	% des Netto-vermögens
(24)	Nasdaq 100 E-mini Future March 2024	(276.423)	(0,14)
(102)	S&P 500 E-mini Future March 2024	(727.005)	(0,37)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Futures-Kontrakten ±		**(1.003.428)**	**(0,51)**

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Verkaufte Optionskontrakte (0,01 %) (31. Dezember 2022: (0,03 %))

Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Art	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Verkaufsoptionen				
(194)	19.07.2024	Chewy Inc, Strike Price $15.00	(15.714)	(0,01)
Beizulegender Zeitwert aus verkauften Optionskontrakten insgesamt ± (Prämie: 17.165 US$)			**(15.714)**	**(0,01)**

Differenzkontrakte (1,40 %) (31. Dezember 2022: (0,58 %))

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
159.813	Agilent Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(2.648)	(0,00)
111.698	Arm Holdings Plc	JPMorgan Chase Bank	(6.563)	(0,00)
198.845	Arm Holdings Plc	Goldman Sachs International	(84.982)	(0,04)
563.898	Best Buy Co Inc	Goldman Sachs International	(30.927)	(0,02)
120.746	Birkenstock Holding Plc	Citibank NA	(41.584)	(0,02)
79.723	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(1.170)	(0,00)
86.748	Cava Group Inc	Goldman Sachs International	(22.316)	(0,01)
94.516	Cava Group Inc	JPMorgan Chase Bank	(7.118)	(0,00)
346.896	Centene Corp	Goldman Sachs International	(39.579)	(0,02)
118.718	Clearway Energy Inc Class C	JPMorgan Chase Bank	(3.706)	(0,00)
108.544	Clearway Energy Inc Class C	Goldman Sachs International	(34.680)	(0,02)
503.325	Credit Acceptance Corp	Goldman Sachs International	(121.458)	(0,06)
308.123	Darden Restaurants Inc	JPMorgan Chase Bank	(3.453)	(0,00)
237.741	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs International	(36.113)	(0,02)
264.106	Davita Healthcare Partner Inc	Goldman Sachs International	(85.980)	(0,04)
263.635	Dollar General Corp	JPMorgan Chase Bank	(12.203)	(0,01)
713.873	Dollar General Corp	Goldman Sachs International	(61.685)	(0,03)
489.369	Eaton Corp Plc	JPMorgan Chase Bank	(7.059)	(0,00)
197.614	Etsy Inc	Goldman Sachs International	(23.084)	(0,01)
300.601	Expeditors International of Washington Inc	JPMorgan Chase Bank	(6.696)	(0,00)
806.258	Floor & Decor Holdings Inc Class A	Goldman Sachs International	(146.879)	(0,08)
67.474	Flowers Foods Inc	Goldman Sachs International	(7.380)	(0,00)
104.544	Fubotv Inc	Goldman Sachs International	(58.101)	(0,03)
215.548	Graco Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.255)	(0,00)
603.484	HubSpot Inc	JPMorgan Chase Bank	(24.737)	(0,01)
401.352	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs International	(47.204)	(0,02)
297.228	Illinois Tool Works Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.158)	(0,00)
141.971	Ingersoll Rand Inc	Goldman Sachs International	(104.302)	(0,05)
341.445	International Business Machines Corp	Goldman Sachs International	(34.696)	(0,02)
61.728	Iron Mountain Inc	Goldman Sachs International	(36.638)	(0,02)
348.452	Iron Mountain Inc	JPMorgan Chase Bank	(10.726)	(0,01)
256.469	ITT Inc	Goldman Sachs International	(58.499)	(0,03)
97.427	J & J Snack Foods Corp	Goldman Sachs International	(9.401)	(0,01)

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Differenzkontrakte (1,40 %) (31. Dezember 2022: (0,58 %)) (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Gegenpartei	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
255.232	JM Smucker Co	JPMorgan Chase Bank	(5.809)	(0,00)
450.200	JM Smucker Co	Goldman Sachs International	(24.614)	(0,01)
189.443	Kroger Co	Goldman Sachs International	(9.069)	(0,01)
525.248	Lamar Advertising Co Class A	Goldman Sachs International	(8.312)	(0,01)
215.939	Landstar System Inc	Goldman Sachs International	(14.663)	(0,01)
32.281	McCormick & Co Inc	JPMorgan Chase Bank	(755)	(0,00)
246.046	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs International	(10.622)	(0,01)
116.057	Mettler-Toledo International	Goldman Sachs International	(29.379)	(0,02)
352.669	Moelis & Co Class A	Goldman Sachs International	(113.510)	(0,06)
579.334	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs International	(25.905)	(0,01)
241.826	Opendoor Technologies Inc	JPMorgan Chase Bank	(33.192)	(0,02)
42.092	Opendoor Technologies Inc	Goldman Sachs International	(45.503)	(0,02)
735.157	Palantir Technologies Inc Class A	Goldman Sachs International	(169.522)	(0,09)
25.221	Paycom Software Inc	JPMorgan Chase Bank	(494)	(0,00)
211.959	Redfin Corp	Goldman Sachs International	(80.707)	(0,04)
47.128	Redfin Corp	JPMorgan Chase Bank	(4.486)	(0,00)
49.456	Robert Half Inc	JPMorgan Chase Bank	(523)	(0,00)
284.924	Robert Half Inc	Goldman Sachs International	(44.764)	(0,02)
367.119	ROBLOX Corp Class A	Goldman Sachs International	(67.783)	(0,04)
536.114	Ryan Specialty Holdings Inc	JPMorgan Chase Bank	(10.272)	(0,01)
488.591	Samsara Inc Class A	Goldman Sachs International	(189.965)	(0,10)
456.684	SAP SE	Goldman Sachs International	(65.829)	(0,03)
387.094	Shutterstock Inc	Goldman Sachs International	(20.365)	(0,01)
310.241	Sonic Automotive Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(9.259)	(0,01)
418.239	Sonic Automotive Inc Class A	Goldman Sachs International	(49.169)	(0,03)
158.382	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs International	(51.682)	(0,03)
208.086	Steelcase Inc Class A	JPMorgan Chase Bank	(18.851)	(0,01)
99.389	Steelcase Inc Class A	Goldman Sachs International	(13.529)	(0,01)
114.505	Sunrun Inc	Goldman Sachs International	(125.524)	(0,06)
797.718	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs International	(100.399)	(0,05)
302.364	T Rowe Price Group Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.050)	(0,00)
356.517	Tesla Inc	Goldman Sachs International	(44.896)	(0,02)
393.283	Texas Instruments Inc	JPMorgan Chase Bank	(4.270)	(0,00)
202.758	Timken Co	Goldman Sachs International	(15.696)	(0,01)
564.163	Trade Desk Inc Class A	Goldman Sachs International	(82.424)	(0,04)
171.949	Upbound Group Inc	Goldman Sachs International	(33.322)	(0,02)
524.827	Walt Disney Co	Goldman Sachs International	(26.539)	(0,01)
156.698	Waters Corp	JPMorgan Chase Bank	(4.463)	(0,00)
Gesamtverlust aus Differenzkontrakten ∞			**(2.740.096)**	**(1,40)**

US Long Short Equity - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Total Return Swap-Kontrakte (2,37 %) (31. Dezember 2022: (0,32 %))

Nominalwert		Datum der Schließung	Variabler Zinssatz	Referenzunternehmen	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettovermögens
USD	(111.720)	19.11.2024	4,57[1]	S&P Retail Select Industry Index[2]	(18.312)	(0,01)
USD	(274.838)	19.11.2024	4,57[1]	S&P Retail Select Industry Index[2]	(23.470)	(0,01)
USD	(336.169)	19.06.2024	4,93[3]	Goldman Sachs GSCBOEC1 Index[4]	(85.623)	(0,04)
USD	(1.089.980)	19.11.2024	4,57[1]	S&P Retail Select Industry Index[2]	(95.606)	(0,05)
USD	(1.554.290)	02.05.2025	5,73[5]	S&P 500 Equal Weight Total Return Index[2]	(185.450)	(0,09)
USD	(1.660.913)	19.11.2024	4,57[1]	S&P Retail Select Industry Index[2]	(366.056)	(0,19)
USD	(1.081.233)	19.01.2024	4,93[3]	Goldman Sachs GSCBOEC1 Index[4]	(401.924)	(0,20)
USD	(3.498.340)	01.11.2024	4,67[1]	JPMorgan Basket JPNBGCND[2]	(442.127)	(0,23)
USD	(3.796.688)	19.07.2024	5,35[1]	JPMorgan Basket JPNBLQGS[2]	(1.070.940)	(0,55)
USD	(4.397.105)	19.01.2024	4,93[3]	Goldman Sachs GSCBOEC1 Index[4]	(1.946.485)	(1,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Total Return Swap-Kontrakten ∞					**(4.635.993)**	**(2,37)**

[1] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Bank Funding Rate.

[2] Die Gegenpartei für die Total Return Swap-Kontrakte ist die JPMorgan Chase Bank.

[3] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die 1-Tages-Overnight Fed Funds Effective Rate.

[4] Die Gegenpartei für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist Goldman Sachs International.

[5] Benchmark für diesen Total Return Swap-Kontrakt ist die USD Secured Overnight Financing Rate.

	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(8.738.101)**	**(4,47)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**173.445.848**	**88,73**
Sonstiges Nettovermögen	**22.024.443**	**11,27**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**195.470.291**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtvermögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	171.484.270	83,10
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	6.303.715	3,05
†	Andere Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente	487.831	0,24
±	Derivative Finanzinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	(1.019.142)	(0,49)
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente und Zentral abgewickelter Swap	(3.810.826)	(1,85)
Anlagen insgesamt		**173.445.848**	**84,05**

US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 99,12 % (31. Dezember 2022: 99,48 %)		
	US-Dollar		
141.000	Alphabet Inc Class C	19.871.130	4,96
90.000	Amazon.com Inc	13.674.600	3,41
98.000	Apollo Global Management Inc	9.132.620	2,28
87.000	Apple Inc	16.750.110	4,18
390.000	Aramark	10.959.000	2,74
33.000	Avery Dennison Corp	6.671.280	1,67
83.000	Ball Corp	4.774.160	1,19
38.000	Becton Dickinson & Co	9.265.540	2,31
57.000	Berkshire Hathaway Inc Class B	20.329.620	5,08
85.000	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	5.666.100	1,41
800	Booking Holdings Inc	2.837.776	0,71
375.000	Brookfield Corp	15.045.000	3,76
150.500	Brookfield Renewable Corp Class A	4.332.895	1,08
77.000	Charles Schwab Corp	5.297.600	1,32
42.000	Chubb Ltd	9.492.000	2,37
375.000	CSX Corp	13.001.250	3,25
12.500	Deere & Co	4.998.375	1,25
45.000	Eagle Materials Inc	9.127.800	2,28
71.000	EOG Resources Inc	8.587.450	2,14
610.000	Graphic Packaging Holding Co	15.036.500	3,75
52.000	HCA Healthcare Inc	14.075.360	3,51
60.000	Intercontinental Exchange Inc	7.705.800	1,92
75.000	JPMorgan Chase & Co	12.757.500	3,19
26.000	Lowe's Cos Inc	5.786.300	1,45
28.500	McDonald's Corp	8.450.535	2,11
51.000	Microsoft Corp	19.178.040	4,79
115.000	Mondelez International Inc Class A	8.329.450	2,08
39.000	Motorola Solutions Inc	12.210.510	3,05
25.000	NIKE Inc Class B	2.714.250	0,68
35.000	Nordson Corp	9.245.600	2,31
47.000	Oracle Corp	4.955.210	1,24
70.000	Pfizer Inc	2.015.300	0,50
45.000	QUALCOMM Inc	6.508.350	1,63
18.500	Rockwell Automation Inc	5.743.880	1,43
59.000	RTX Corp	4.964.260	1,24
140.000	Simply Good Foods Co	5.544.000	1,38
62.000	TJX Cos Inc	5.816.220	1,45
73.000	T-Mobile US Inc	11.704.090	2,92
58.000	TransUnion	3.985.180	1,00

US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 99,12 % (31. Dezember 2022: 99,48 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
230.000	US Foods Holding Corp	10.444.300	2,61
50.000	Veralto Corp	4.113.000	1,03
26.800	Verisk Analytics Inc Class A	6.401.448	1,60
245.000	Vestis Corp	5.179.300	1,29
40.000	Walt Disney Co	3.611.600	0,90
15.000	WD-40 Co	3.586.050	0,90
56.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	7.106.400	1,77
	Aktien insgesamt *	**396.982.739**	**99,12**
	Anlagen insgesamt	**396.982.739**	**99,12**

Devisenterminkontrakte 0,46 % (31. Dezember 2022: 0,62 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen AUD						
309.370 AUD	203.525 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	10	7.686	0,00
44.702 AUD	29.202 US$	18.01.2024	UBS AG	2	1.316	0,00
6.414.487 AUD	4.133.475 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	49	245.732	0,06
33.511 US$	48.887 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	135	0,00
Abgesicherte Klassen EUR						
440.742 €	478.539 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	8.630	0,00
4.559.276 €	4.867.842 US$	18.01.2024	UBS AG	12	171.697	0,04
4.163.917 €	4.441.972 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	22	160.563	0,04
4 US$	3 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	1	0,00
Abgesicherte Klassen SGD						
26.365.512 SGD	19.409.150 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	592.968	0,15
430.097 SGD	323.615 US$	18.01.2024	UBS AG	2	2.678	0,00
6.273.972 SGD	4.661.567 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	74	98.165	0,03
6.589 US$	8.666 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	13	0,00
Abgesicherte Klassen ZAR						
23.498 US$	430.060 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	12	0,00
188.922.504 ZAR	9.812.173 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	16	504.741	0,13
6.775.352 ZAR	367.493 US$	18.01.2024	UBS AG	4	2.503	0,00
21.096.132 ZAR	1.104.994 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	48	47.052	0,01
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**1.843.892**	**0,46**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**398.826.631**	**99,58**

US Multi Cap Opportunities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,13 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen AUD						
21.743 AUD	14.884 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(40)	(0,00)
57.926 US$	91.149 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(4.303)	(0,00)
43.110 US$	67.061 AUD	18.01.2024	UBS AG	3	(2.672)	(0,00)
2.110.656 US$	3.268.260 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	29	(120.603)	(0,03)
Abgesicherte Klassen EUR						
56.302 €	62.382 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(149)	(0,00)
259.220 US$	240.689 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(6.822)	(0,00)
661.661 US$	617.379 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	26	(20.752)	(0,01)
Abgesicherte Klassen SGD						
232.425 SGD	176.340 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(11)	(0,00)
355.916 US$	486.316 SGD	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	(13.026)	(0,00)
750.752 US$	1.010.428 SGD	18.01.2024	UBS AG	4	(15.806)	(0,00)
812.239 US$	1.103.644 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	47	(25.034)	(0,01)
Abgesicherte Klassen ZAR						
601.473 US$	11.394.678 ZAR	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	(20.781)	(0,01)
130.705 US$	2.492.102 ZAR	18.01.2024	UBS AG	2	(5.387)	(0,00)
3.771.483 US$	70.702.645 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	60	(89.532)	(0,02)
2.832.221 ZAR	154.848 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(182)	(0,00)
1.891.154 ZAR	103.344 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(70)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(325.170)**	**(0,08)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(325.170)**	**(0,08)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**398.501.461**	**99,50**
Sonstiges Nettovermögen	**1.990.574**	**0,50**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**400.492.035**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	396.982.739	98,08
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	1.518.722	0,38
Anlagen insgesamt		**398.501.461**	**98,46**

US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettovermögens
	Immobilienaktiengesellschaften 97,54 % (31. Dezember 2022: 96,38 %)		
	US-Dollar		
121.919	American Homes 4 Rent Class A	4.384.207	0,82
219.683	American Tower Corp	47.425.166	8,90
439.835	Apartment Income REIT Corp	15.275.470	2,86
55.010	AvalonBay Communities Inc	10.298.972	1,93
90.198	Boston Properties Inc	6.329.194	1,19
220.826	Crown Castle Inc	25.436.947	4,77
22.234	EastGroup Properties Inc	4.080.828	0,77
48.934	Equinix Inc	39.410.954	7,39
141.468	Equity LifeStyle Properties Inc	9.979.153	1,87
167.245	Equity Residential	10.228.704	1,92
62.173	Essex Property Trust Inc	15.415.174	2,89
144.883	Extra Space Storage Inc	23.229.091	4,36
1.689.358	Hudson Pacific Properties Inc	15.727.923	2,95
231.967	Invitation Homes Inc	7.912.394	1,48
197.062	Iron Mountain Inc	13.790.399	2,59
719.534	Kimco Realty Corp	15.333.270	2,88
225.732	Omega Healthcare Investors Inc	6.920.943	1,30
324.653	Prologis Inc	43.276.245	8,12
125.588	Public Storage	38.304.340	7,18
343.674	Realty Income Corp	19.733.761	3,70
87.265	Regency Centers Corp	5.846.755	1,10
331.087	Retail Opportunity Investments Corp	4.645.151	0,87
116.925	Rexford Industrial Realty Inc	6.559.492	1,23
73.893	SBA Communications Corp Class A	18.745.915	3,52
162.548	Simon Property Group Inc	23.185.847	4,35
110.587	Sun Communities Inc	14.779.953	2,77
326.027	Urban Edge Properties	5.966.294	1,12
301.129	Ventas Inc	15.008.269	2,81
556.658	VICI Properties Inc Class A	17.746.257	3,33
234.529	Welltower Inc	21.147.480	3,97
398.852	Weyerhaeuser Co	13.868.084	2,60
	Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *	**519.992.632**	**97,54**
	Anlagen insgesamt	**519.992.632**	**97,54**

Devisenterminkontrakte 0,44 % (31. Dezember 2022: 0,63 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettovermögens
Abgesicherte Klassen AUD						
2.873.492 AUD	1.881.598 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	12	80.152	0,02
93.559 AUD	61.784 US$	18.01.2024	UBS AG	1	2.089	0,00

US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,44 % (31. Dezember 2022: 0,63 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)						
18.939.439 AUD	12.234.992 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	56	695.063	0,13
22.598 US$	32.922 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	122	0,00
Abgesicherte Klassen CHF						
46.624 CHF	53.451 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	2	2.035	0,00
276.345 CHF	314.116 US$	18.01.2024	UBS AG	12	14.756	0,00
1.451.336 CHF	1.623.510 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	11	103.698	0,02
Abgesicherte Klassen EUR						
923.859 €	1.001.049 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	20.126	0,00
7.587.713 €	8.102.760 US$	18.01.2024	UBS AG	9	284.223	0,05
7.303.172 €	7.798.585 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	37	273.887	0,05
6.405 US$	5.765 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	33	0,00
Abgesicherte Klassen HKD						
2.678.511 HKD	342.805 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	336	0,00
6.832.786 HKD	874.809 US$	18.01.2024	UBS AG	11	532	0,00
40.927.346 HKD	5.241.857 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	23	1.302	0,00
74.012 US$	577.077 HKD	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	83	0,00
33.757 US$	263.178 HKD	18.01.2024	UBS AG	1	42	0,00
153.746 US$	1.199.417 HKD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	13	90	0,00
Abgesicherte Klassen SGD						
512.228 SGD	377.288 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	10	11.313	0,00
38.604 SGD	28.833 US$	18.01.2024	UBS AG	5	454	0,00
395.416 SGD	296.359 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	46	3.622	0,00
Abgesicherte Klassen ZAR						
59.404 US$	1.086.911 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	49	0,00
318.645.195 ZAR	16.579.353 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	16	821.621	0,16
30.019.882 ZAR	1.619.559 US$	18.01.2024	UBS AG	6	19.805	0,00
20.287.353 ZAR	1.084.466 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	45	23.414	0,01
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten [∞]					**2.358.847**	**0,44**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**522.351.479**	**97,98**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,19 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen AUD						
134.183 AUD	91.744 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(137)	(0,00)
430.034 AUD	294.511 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(924)	(0,00)

US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte (0,08 %) (31. Dezember 2022: (0,19 %)) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)						
788.581 US$	1.223.851 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	(46.948)	(0,01)
514.671 US$	803.058 AUD	18.01.2024	UBS AG	4	(33.580)	(0,01)
1.081.164 US$	1.667.596 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	54	(57.313)	(0,01)
Abgesicherte Klassen CHF						
31.295 CHF	37.303 US$	18.01.2024	UBS AG	2	(59)	(0,00)
9.309 US$	8.181 CHF	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(427)	(0,00)
256.007 US$	226.567 CHF	18.01.2024	UBS AG	13	(13.628)	(0,00)
133.815 US$	119.528 CHF	18.01.2024	Westpac Banking Corp	4	(8.433)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
246.349 €	272.836 US$	18.01.2024	UBS AG	2	(537)	(0,00)
6 €	7 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(0)	(0,00)
756.505 US$	703.432 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	5	(21.026)	(0,00)
1.582.822 US$	1.483.642 €	18.01.2024	UBS AG	3	(57.102)	(0,01)
2.763.151 US$	2.585.217 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	61	(94.391)	(0,02)
Abgesicherte Klassen HKD						
242.525 HKD	31.118 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	1	(49)	(0,00)
4.287.478 HKD	549.583 US$	18.01.2024	UBS AG	5	(319)	(0,00)
2.603.496 HKD	333.868 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	14	(337)	(0,00)
359.080 US$	2.805.445 HKD	18.01.2024	Goldman Sachs International	4	(322)	(0,00)
165.146 US$	1.289.659 HKD	18.01.2024	UBS AG	3	(71)	(0,00)
1.140.954 US$	8.912.870 HKD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	23	(863)	(0,00)
Abgesicherte Klassen SGD						
6.071 SGD	4.606 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(1)	(0,00)
12.629 SGD	9.582 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(1)	(0,00)
18.157 US$	24.803 SGD	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(659)	(0,00)
17.509 US$	23.587 SGD	18.01.2024	UBS AG	4	(385)	(0,00)
46.957 US$	63.244 SGD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	17	(1.023)	(0,00)
Abgesicherte Klassen ZAR						
1.808.703 US$	34.110.867 ZAR	18.01.2024	Goldman Sachs International	9	(54.066)	(0,01)
669.603 US$	12.737.557 ZAR	18.01.2024	UBS AG	3	(25.985)	(0,01)
1.477.768 US$	27.465.401 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	63	(22.097)	(0,00)
14.137.244 ZAR	772.934 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(910)	(0,00)
2.428.492 ZAR	132.708 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	1	(90)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten [∞]					**(441.683)**	**(0,08)**

US Real Estate Securities - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(441.683)**	**(0,08)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**521.909.796**	**97,90**
Sonstiges Nettovermögen	**11.200.189**	**2,10**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**533.109.985**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	519.992.632	96,04
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	1.917.164	0,35
Anlagen insgesamt		**521.909.796**	**96,39**

US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 98,17 % (31. Dezember 2022: 97,70 %)		
	US-Dollar		
37.393	Advanced Energy Industries Inc*	4.072.846	0,64
78.139	AMERISAFE Inc*	3.655.342	0,58
71.641	Amphastar Pharmaceuticals Inc*	4.430.996	0,70
46.283	AptarGroup Inc*	5.721.504	0,90
61.305	Arcosa Inc*	5.066.245	0,80
46.889	Asbury Automotive Group Inc*	10.548.618	1,66
32.766	Aspen Technology Inc*	7.213.435	1,14
7.966	Atrion Corp*	3.017.441	0,48
52.980	Bank of Hawaii Corp*	3.838.931	0,61
135.203	Bio-Techne Corp*	10.432.264	1,65
37.206	Bright Horizons Family Solutions Inc*	3.506.293	0,55
6.549	Cable One Inc*	3.645.108	0,57
74.299	Cactus Inc Class A*	3.373.175	0,53
22.063	Casella Waste Systems Inc Class A*	1.885.504	0,30
27.138	CBIZ Inc*	1.698.567	0,27
20.587	Chemed Corp*	12.038.248	1,90
27.107	Church & Dwight Co Inc*	2.563.238	0,40
9.093	Colliers International Group Inc*	1.150.446	0,18
120.818	Community Bank System Inc*	6.295.826	0,99
63.837	CommVault Systems Inc*	5.097.384	0,80
8.969	CorVel Corp*	2.217.227	0,35
24.013	CRA International Inc*	2.373.685	0,37
16.294	Crane Co*	1.924.973	0,30
48.907	CSW Industrials Inc*	10.143.801	1,60
58.569	Cullen/Frost Bankers Inc*	6.354.151	1,00
56.425	Eagle Materials Inc*	11.445.247	1,81
226.543	Element Solutions Inc*	5.242.205	0,83
76.757	ESAB Corp*	6.648.691	1,05
31.175	ESCO Technologies Inc*	3.648.410	0,58
101.227	Exponent Inc*	8.912.025	1,41
13.554	Fair Isaac Corp*	15.776.991	2,49
11.500	Federal Signal Corp*	882.510	0,14
135.491	First Financial Bankshares Inc*	4.105.377	0,65
63.930	FirstService Corp*	10.362.414	1,63
59.431	Floor & Decor Holdings Inc Class A*	6.630.122	1,05
85.547	Fox Factory Holding Corp*	5.772.712	0,91
48.882	FTI Consulting Inc*	9.734.850	1,54
122.704	Glacier Bancorp Inc*	5.070.129	0,80
73.335	Graco Inc*	6.362.545	1,00

US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 98,17 % (31. Dezember 2022: 97,70 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
85.445	Grocery Outlet Holding Corp*	2.303.597	0,36
119.734	Haemonetics Corp*	10.238.454	1,61
150.632	Hagerty Inc Class A*	1.174.930	0,19
27.485	Hamilton Lane Inc Class A*	3.117.898	0,49
306.024	Hayward Holdings Inc*	4.161.926	0,66
359.027	Hillman Solutions Corp*	3.306.639	0,52
40.244	Houlihan Lokey Inc Class A*	4.825.658	0,76
20.521	ICON Plc*	5.808.880	0,92
24.745	Jack Henry & Associates Inc*	4.043.580	0,64
40.605	Kadant Inc*	11.381.988	1,80
127.563	Kirby Corp*	10.011.144	1,58
46.231	Lakeland Financial Corp*	3.012.412	0,47
176.798	Lattice Semiconductor Corp*	12.197.294	1,92
32.633	LCI Industries*	4.102.294	0,65
35.628	Lindsay Corp*	4.601.713	0,73
42.393	Littelfuse Inc*	11.342.671	1,79
64.542	Manhattan Associates Inc*	13.897.183	2,19
10.929	MarketAxess Holdings Inc*	3.200.558	0,50
68.328	Matador Resources Co*	3.885.130	0,61
39.296	MKS Instruments Inc*	4.042.380	0,64
142.507	Model N Inc*	3.837.714	0,61
87.067	NetScout Systems Inc*	1.911.121	0,30
57.295	Nexstar Media Group Inc Class A*	8.980.991	1,42
24.761	Nordson Corp*	6.540.866	1,03
36.418	Novanta Inc*	6.133.155	0,97
201.363	Oceaneering International Inc*	4.285.005	0,68
23.397	Omega Flex Inc*	1.649.723	0,26
34.423	Pool Corp*	13.724.794	2,16
124.599	Power Integrations Inc*	10.230.824	1,61
68.117	Prosperity Bancshares Inc*	4.613.564	0,73
16.785	Quaker Chemical Corp*	3.582.255	0,56
74.528	Qualys Inc*	14.628.356	2,31
35.900	QuidelOrtho Corp*	2.645.830	0,42
44.742	RBC Bearings Inc*	12.746.548	2,01
105.513	Richelieu Hardware Ltd**	3.839.310	0,61
44.364	RLI Corp*	5.905.736	0,93
16.016	Rogers Corp*	2.115.233	0,33
109.185	Rollins Inc*	4.768.109	0,75
50.904	Shift4 Payments Inc Class A*	3.784.203	0,60

US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 98,17 % (31. Dezember 2022: 97,70 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
77.552	Simply Good Foods Co*	3.071.059	0,48
61.374	Simulations Plus Inc*	2.746.487	0,43
24.253	SiteOne Landscape Supply Inc*	3.941.113	0,62
240.059	Sitio Royalties Corp Class A*	5.643.787	0,89
732.554	Southwestern Energy Co*	4.798.229	0,76
67.623	SPS Commerce Inc*	13.108.042	2,07
74.392	SPX Technologies Inc*	7.514.336	1,19
33.641	Standex International Corp*	5.328.062	0,84
142.724	Stevanato Group SpA*	3.894.938	0,61
47.318	Stewart Information Services Corp*	2.779.933	0,44
59.889	Stock Yards Bancorp Inc*	3.083.685	0,49
60.233	TechTarget Inc*	2.099.722	0,33
52.827	Tetra Tech Inc*	8.818.411	1,39
1.574	Texas Pacific Land Corp*	2.475.036	0,39
62.223	Texas Roadhouse Inc Class A*	7.605.517	1,20
115.368	Tidewater Inc*	8.319.187	1,31
82.578	Toro Co*	7.926.662	1,25
20.682	Tractor Supply Co*	4.447.250	0,70
42.721	Transcat Inc*	4.670.687	0,74
338.431	Transocean Ltd*	2.149.037	0,34
14.549	Tyler Technologies Inc*	6.083.228	0,96
35.028	UFP Technologies Inc*	6.026.217	0,95
155.576	United Community Banks Inc*	4.552.154	0,72
164.464	Utz Brands Inc*	2.670.895	0,42
40.334	Valmont Industries Inc*	9.418.392	1,49
149.819	Vertex Inc Class A*	4.036.124	0,64
29.301	Viper Energy Inc Class A*	919.465	0,14
17.810	Watsco Inc*	7.631.051	1,20
23.118	WD-40 Co*	5.526.820	0,87
17.590	West Pharmaceutical Services Inc*	6.193.791	0,98
12.869	Winmark Corp*	5.373.451	0,85
	Aktien insgesamt	**622.291.910**	**98,17**
	Anlagen insgesamt	**622.291.910**	**98,17**

Devisenterminkontrakte 0,12 % (31. Dezember 2022: 0,16 %)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen AUD						
663.184 AUD	438.432 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	11	14.327	0,00
102.572 AUD	67.141 US$	18.01.2024	UBS AG	2	2.885	0,00

US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Devisenterminkontrakte 0,12 % (31. Dezember 2022: 0,16 %) (Fortsetzung)

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen AUD (Fortsetzung)						
5.870.939 AUD	3.798.314 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	65	209.810	0,04
44.051 US$	64.271 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	173	0,00
Abgesicherte Klassen EUR						
820.150 €	890.872 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	7	15.671	0,00
5.614.812 €	6.000.947 US$	18.01.2024	UBS AG	8	205.316	0,03
5.491.825 €	5.856.660 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	32	213.660	0,04
2.046 US$	1.841 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	11	0,00
Abgesicherte Klassen ZAR						
478 US$	8.752 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	3	0	0,00
30.419.765 ZAR	1.581.114 US$	18.01.2024	Goldman Sachs International	14	80.087	0,01
1.874.208 ZAR	101.065 US$	18.01.2024	UBS AG	4	1.284	0,00
2.467.135 ZAR	130.584 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	57	4.146	0,00
Nicht realisierter Gesamtgewinn aus Devisenterminkontrakten ∞					**747.370**	**0,12**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	**623.039.280**	**98,29**

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,02 %) (31. Dezember 2022: (0,04 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
Abgesicherte Klassen AUD						
96.488 AUD	66.076 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(204)	(0,00)
202.850 US$	318.229 AUD	18.01.2024	Goldman Sachs International	6	(14.406)	(0,00)
101.170 US$	156.820 AUD	18.01.2024	UBS AG	3	(5.892)	(0,00)
294.871 US$	453.035 AUD	18.01.2024	Westpac Banking Corp	22	(14.418)	(0,00)
Abgesicherte Klassen EUR						
141.582 €	156.871 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(375)	(0,00)
5.416 €	6.018 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(33)	(0,00)
370.796 US$	345.198 €	18.01.2024	Goldman Sachs International	3	(10.764)	(0,00)
507.722 US$	473.303 €	18.01.2024	UBS AG	5	(15.437)	(0,01)
2.095.460 US$	1.950.590 €	18.01.2024	Westpac Banking Corp	35	(60.600)	(0,01)
Abgesicherte Klassen ZAR						
195.113 US$	3.683.472 ZAR	18.01.2024	Goldman Sachs International	11	(6.040)	(0,00)
25.308 US$	482.777 ZAR	18.01.2024	UBS AG	2	(1.057)	(0,00)
351.844 US$	6.586.479 ZAR	18.01.2024	Westpac Banking Corp	29	(7.838)	(0,00)
1.060.425 ZAR	57.977 US$	18.01.2024	UBS AG	1	(68)	(0,00)
316.209 ZAR	17.281 US$	18.01.2024	Westpac Banking Corp	2	(12)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(137.144)**	**(0,02)**

US Small Cap - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(137.144)**	**(0,02)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**622.902.136**	**98,27**
Sonstiges Nettovermögen	**10.949.633**	**1,73**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**633.851.769**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	618.452.600	96,92
**	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	3.839.310	0,60
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	610.226	0,10
Anlagen insgesamt		**622.902.136**	**97,62**

US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Netto-vermögens
	Aktien 93,24 % (31. Dezember 2022: 95,19 %)		
	US-Dollar		
84.415	Acadia Healthcare Co Inc	6.564.110	2,04
380.398	Accuray Inc	1.076.526	0,33
248.494	Adeia Inc	3.078.841	0,96
86.096	AerCap Holdings NV	6.398.655	1,99
32.377	ALLETE Inc	1.980.177	0,62
254.609	Amneal Pharmaceuticals Inc	1.545.477	0,48
51.794	Arcosa Inc	4.280.256	1,33
15.764	Atmos Energy Corp	1.827.048	0,57
57.631	AtriCure Inc	2.056.850	0,64
60.537	Avanos Medical Inc	1.357.845	0,42
36.723	Avery Dennison Corp	7.423.922	2,31
492.501	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	719.052	0,23
56.856	Banc of California Inc	763.576	0,24
82.926	BankUnited Inc	2.689.290	0,84
138.056	Bloom Energy Corp Class A	2.043.229	0,63
71.643	Box Inc Class A	1.834.777	0,57
31.318	Bread Financial Holdings Inc	1.031.615	0,32
69.456	Caleres Inc	2.134.383	0,66
46.405	Cannae Holdings Inc	905.362	0,28
54.920	CEVA Inc	1.247.233	0,39
14.573	Charles River Laboratories International Inc	3.445.057	1,07
30.371	Children's Place Inc	705.215	0,22
164.214	Ciena Corp	7.391.272	2,30
13.839	Clean Harbors Inc	2.415.044	0,75
305.734	Cleveland-Cliffs Inc	6.243.088	1,94
136.776	CNX Resources Corp	2.735.520	0,85
387.333	Cognyte Software Ltd	2.490.551	0,77
56.345	Coherent Corp	2.452.698	0,76
47.679	Comerica Inc	2.660.965	0,83
1.059.403	Conduent Inc	3.866.821	1,20
289.019	Criteo SA ADR	7.317.961	2,28
76.859	Crown Holdings Inc	7.077.945	2,20
95.537	CytoSorbents Corp	106.046	0,03
119.898	Devon Energy Corp	5.431.379	1,69
57.794	Dril-Quip Inc	1.344.866	0,42
144.536	EMCORE Corp	70.678	0,02
74.640	Enerpac Tool Group Corp Class A	2.320.558	0,72
6.829	Entegris Inc	818.251	0,26
329.977	Enviri Corp	2.969.793	0,92

US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 93,24 % (31. Dezember 2022: 95,19 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
41.604	Haemonetics Corp	3.557.558	1,11
184.166	Hain Celestial Group Inc	2.016.618	0,63
187.703	Huntington Bancshares Inc	2.387.582	0,74
89.672	indie Semiconductor Inc Class A	727.240	0,23
208.829	Infinera Corp	991.938	0,31
337.929	Innoviz Technologies Ltd	854.960	0,27
40.928	Integra LifeSciences Holdings Corp	1.782.414	0,56
287.290	International Game Technology Plc	7.874.619	2,45
11.018	ION Geophysical Corp	0	0,00
53.191	Itron Inc	4.016.452	1,25
159.083	KBR Inc	8.814.789	2,74
380.975	Kyndryl Holdings Inc	7.916.660	2,46
498.337	Lions Gate Entertainment Corp Class B	5.078.054	1,58
97.862	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	9.096.273	2,83
290.419	Markforged Holding Corp	238.143	0,07
47.789	Mercury Systems Inc	1.747.644	0,54
16.454	Molina Healthcare Inc	5.944.995	1,85
41.267	New Jersey Resources Corp	1.839.683	0,57
81.234	nLight Inc	1.096.659	0,34
35.051	Northwestern Energy Group Inc	1.783.745	0,55
70.976	ODP Corp	3.995.949	1,24
202.599	Oil States International Inc	1.375.647	0,42
119.246	OneSpan Inc	1.278.317	0,40
240.242	OPENLANE Inc	3.557.984	1,11
239.817	OraSure Technologies Inc	1.966.499	0,61
72.888	Ormat Technologies Inc	5.524.181	1,72
23.588	OSI Systems Inc	3.044.031	0,95
106.320	Patterson Cos Inc	3.024.804	0,94
142.914	Patterson-UTI Energy Inc	1.543.471	0,48
42.425	Portland General Electric Co	1.838.699	0,57
700.683	Quantum Corp	244.538	0,08
83.886	Radware Ltd	1.399.219	0,43
121.051	Rambus Inc	8.261.731	2,57
285.707	Resideo Technologies Inc	5.377.006	1,67
1.042.473	Ribbon Communications Inc	3.023.172	0,94
37.477	SeaWorld Entertainment Inc	1.979.910	0,62
97.814	Semtech Corp	2.143.105	0,66
323.853	Standard BioTools Inc	715.715	0,22
75.463	Stericycle Inc	3.739.946	1,16

US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

Anzahl der Anteile	Wertpapierbezeichnung	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Aktien 93,24 % (31. Dezember 2022: 95,19 %) (Fortsetzung)		
	US-Dollar (Fortsetzung)		
288.412	Stratasys Ltd	4.118.524	1,28
247.373	TechnipFMC Plc	4.982.092	1,55
6.492	Teledyne Technologies Inc	2.897.315	0,90
69.016	Tempur Sealy International Inc	3.517.746	1,09
418.271	TETRA Technologies Inc	1.890.585	0,59
67.085	Texas Capital Bancshares Inc	4.335.704	1,35
80.919	TreeHouse Foods Inc	3.354.093	1,04
14.272	Twin Discount Inc	230.635	0,07
210.262	Under Armour Inc Class C	1.755.688	0,55
391.961	Unisys Corp	2.202.821	0,69
72.756	Varex Imaging Corp	1.491.498	0,46
59.217	Varonis Systems Inc Class B	2.681.346	0,83
258.887	Veeco Instruments Inc	8.033.264	2,50
86.666	Verint Systems Inc	2.342.582	0,73
182.898	Viasat Inc	5.111.999	1,59
190.145	Viavi Solutions Inc	1.914.760	0,60
175.918	Vistra Corp	6.776.361	2,11
28.410	Wix.com Ltd	3.494.998	1,09
198.791	Xperi Inc	2.190.677	0,68
106.017	Zimvie Inc	1.881.802	0,59
	Aktien insgesamt *	**299.826.372**	**93,24**
	Immobilienaktiengesellschaften 0,59 % (31. Dezember 2022: 1,12 %)		
	US-Dollar		
84.616	Chatham Lodging Trust	907.084	0,28
85.609	RLJ Lodging Trust	1.003.337	0,31
	Immobilienaktiengesellschaften insgesamt *	**1.910.421**	**0,59**

Kapital-betrag	Wertpapierbezeichnung	Kupon	Fälligkeits-datum	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
	Unternehmensanleihen 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
	US-Dollar				
32.000	Ion Geophysical Escrow Corp	8,00 %	15.12.2025	0	0,00
	Unternehmensanleihen insgesamt *			**0**	**0,00**
	Anlagen insgesamt			**301.736.793**	**93,83**
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				**301.736.793**	**93,83**

US Small Cap Intrinsic Value - Aufstellung des Wertpapierbestands (Fortsetzung)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

Devisenterminkontrakte (0,00 %) (31. Dezember 2022: (0,00 %))

Geforderter Betrag	Zu zahlender Betrag	Fälligkeits-datum	Gegenpartei	Kontrakte	Nicht realisierter Verlust US$	% des Nettover-mögens
70.545 US$	10.000.000 ¥	04.01.2024	Brown Brothers Harriman	1	(398)	(0,00)
Nicht realisierter Gesamtverlust aus Devisenterminkontrakten ∞					**(398)**	**(0,00)**

	Zeitwert US$	% des Nettover-mögens
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	**(398)**	**(0,00)**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, netto	**301.736.395**	**93,83**
Sonstiges Nettovermögen	**19.832.222**	**6,17**
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen	**321.568.617**	**100,00**

Portfolioanalyse		US$	% des Gesamtver-mögens
*	Wertpapiere und/oder Geldmarktinstrumente, die zur Notierung an einer amtlichen Börse zugelassen sind	301.736.793	93,70
∞	OTC-gehandelte derivative Finanzinstrumente	(398)	0,00
Anlagen insgesamt		**301.736.395**	**93,70**

Bilanzen

	Anm.	5G Connectivity Zum 31. Dezember 2023 US$	Absolute Return Multi Strategy Zum 31. Dezember 2023* US$	China A-Share Equity Zum 31. Dezember 2023 CNY	China Bond Zum 31. Dezember 2023 CNY	China Equity Zum 31. Dezember 2023 US$	Climate Innovation Zum 31. Dezember 2023 US$	CLO Income Zum 31. Dezember 2023 US$	Commodities Zum 31. Dezember 2023 US$
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	996.857.530	6.311	13.480.937	447.117.129	172.463.571	2.831.398	179.297.062	122.546.345
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	43.643.862	98.859	1.074.845	9.446.611	6.017.190	83.875	12.287.210	33.206.631
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		11.966.904	737	26.607	–	908.831	27.029	–	306
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		871.569	–	–	–	–	–	–	589.538
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	–	682.867	–	–	–	7.330.000
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		360.533	1.078	192.783	5.178.845	92.331	14.640	3.974.020	662.121
Vermögenswerte insgesamt		1.053.700.398	106.985	14.775.172	462.425.452	179.481.923	2.956.942	195.558.292	164.334.941
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	1.033.321	–	–	2.361.945	423.344	–	2.570.754	210.126
Kontenüberziehung	*4*	68	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		5.027.207	–	–	637.738	561.527	–	–	90.830
Antizipative Passiva		1.457.148	11.217	359.457	422.278	244.205	3.183	149.265	135.790
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		2.582.227	–	150.009	606	451	27.707	7.173.352	10.239.576
Sonstige Verbindlichkeiten		73.484	95.768	51.874	156.777	26.109	3.497	18.616	12.060
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		10.173.455	106.985	561.340	3.579.344	1.255.636	34.387	9.911.987	10.688.382
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		1.043.526.943	–	14.213.832	458.846.108	178.226.287	2.922.555	185.646.305	153.646.559

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	Corporate Hybrid Bond Zum 31. Dezember 2023 EUR	Developed Market FMP – 2027 Zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Market Debt - Hard Currency Zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Market Debt - Local Currency Zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Market Debt Blend Zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Markets Equity Zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Markets Select Equity Zum 31. Dezember 2023* US$
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	1.766.641.213	135.817.055	2.588.612.804	1.244.671.584	504.428.604	61.503.601	89.056.214	–
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	79.423.824	503.437	2.306.275	34.899.630	15.095.815	2.754.078	3.296.182	163.972
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.744	–	23.722	838	252.512	20.345	194	–
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		7.249.268	–	8.718.437	1.094.199	178.023	1.182	25.864	–
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	22.175.962	16.010.321	7.902.696	679.691	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		30.551.766	1.479.818	55.368.515	25.831.472	10.166.996	915.984	271.103	20.832
Vermögenswerte insgesamt		1.883.867.815	137.800.310	2.677.205.715	1.322.508.044	538.024.646	65.874.881	92.649.557	184.804
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	7.732.130	393	15.874.903	27.976.015	8.849.676	679.582	787.152	–
Kontenüberziehung	*4*	–	–	31.716	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		5.064.442	239.940	8.966.177	781.709	500.516	–	128.823	–
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	–	2.230.000	390.000	–	–	–
Antizipative Passiva		1.188.602	100.867	1.919.504	1.023.619	449.175	70.618	142.423	47.821
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		–	35	–	–	393	243	409.316	–
Sonstige Verbindlichkeiten		66.178	1.256	594.760	4.629.054	1.047.079	56.889	494.342	136.983
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		14.051.352	342.491	27.387.060	36.640.397	11.236.839	807.332	1.962.056	184.804
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		1.869.816.463	137.457.819	2.649.818.655	1.285.867.647	526.787.807	65.067.549	90.687.501	–

* Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	Euro Bond Zum 31. Dezember 2023 EUR	Euro Bond Absolute Return Zum 31. Dezember 2023 EUR	European High Yield Bond Zum 31. Dezember 2023 EUR	European Sustainable Equity Zum 31. Dezember 2023 EUR	Event Driven Zum 31. Dezember 2023 US$	Global Bond Zum 31. Dezember 2023 US$	Global Diversified Income FMP – 2024 Zum 31. Dezember 2023 US$	Global Equity Megatrends Zum 31. Dezember 2023 US$
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	10.219.503	33.385.909	387.635.250	171.225.790	120.057.191	111.175.172	144.239.599	141.493.045
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	127.676	460.317	16.624.528	1.127.268	13.500.176	1.162.072	11.026.949	5.262.402
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	–	10	1.032.578	253	–	–	1.620
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		–	–	102.548	443	441.776	240	–	788.588
Forderungen gegenüber Brokern		217.984	1.822.858	–	–	–	802.148	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		145.715	473.859	6.544.828	120.283	10.722	1.061.825	1.098.172	273.742
Vermögenswerte insgesamt		10.710.878	36.142.943	410.907.164	173.506.362	134.010.118	114.201.457	156.364.720	147.819.397
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	81.140	1.615.336	1.281.452	–	155.365	3.890.491	–	–
Kontenüberziehung	*4*	–	412.247	–	42	–	–	13	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		–	–	98.287	1.292.679	161.583	14.939	–	3.100.333
Antizipative Passiva		42.325	47.082	110.226	84.070	79.389	80.067	123.837	224.956
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		–	–	963.852	1.639	5.896.768	1.438.589	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		14.319	41.451	37.030	30.381	1.304.865	34.571	41.217	11.252
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		137.784	2.116.116	2.490.847	1.408.811	7.597.970	5.458.657	165.067	3.336.541
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		10.573.094	34.026.827	408.416.317	172.097.551	126.412.148	108.742.800	156.199.653	144.482.856

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	Global Flexible Credit Income Zum 31. Dezember 2023 US$	Global SDG Engagement Zum 31. Dezember 2023 US$	Global High Yield Sustainable Action Zum 31. Dezember 2023* US$	Global Investment Grade Credit Zum 31. Dezember 2023 US$	Global Opportunistic Bond Zum 31. Dezember 2023 US$	Global Real Estate Securities Zum 31. Dezember 2023 US$	Global Sustainable Equity Zum 31. Dezember 2023 US$	Global Sustainable Value Zum 31. Dezember 2023 US$
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	368.099.040	544.440.088	–	83.459.890	70.656.593	20.510.136	153.603.419	54.991.923
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	25.482.094	10.709.205	52.318	3.401.463	1.529.454	211.649	781.170	544.936
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	820.711	–	–	110.692	–	618.618	–
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		435.297	187.598	–	–	19.690	12.500	159.181	20.869
Forderungen gegenüber Brokern		3.225.584	–	–	–	1.153.721	–	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		5.792.332	9.463.589	1	1.093.184	732.900	102.538	72.293	84.087
Vermögenswerte insgesamt		403.034.347	565.621.191	52.319	87.954.537	74.203.050	20.836.823	155.234.681	55.641.815
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	8.620.881	6.738.234	–	1.107.450	7.756.007	250.684	–	46.897
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		1.835.312	345.199	–	–	–	54.826	9.808	17.218
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		200.000	–	–	–	–	–	–	–
Antizipative Passiva		238.837	244.147	29.617	46.561	72.646	58.316	77.887	65.609
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		1.500.862	97.458	–	–	911.501	1	540.903	6
Sonstige Verbindlichkeiten		25.474	32.248	22.702	22.701	53.133	12.983	32.788	46.191
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		12.421.366	7.457.286	52.319	1.176.712	8.793.287	376.810	661.386	175.921
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		390.612.981	558.163.905	–	86.777.825	65.409.763	20.460.013	154.573.295	55.465.894

* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	High Yield Bond Zum 31. Dezember 2023 US$	InnovAsia 5G Zum 31. Dezember 2023 US$	Japan Equity Engagement Zum 31. Dezember 2023 JPY	Macro Opportunities FX Zum 31. Dezember 2023 EUR	Multi-Asset Income Zum 31. Dezember 2023* US$	Next Generation Mobility Zum 31. Dezember 2023 US$	Next Generation Space Economy Zum 31. Dezember 2023 US$	Responsible Asian Debt - Hard Currency Zum 31. Dezember 2023 US$
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	2.133.705.667	22.824.022	16.090.377.079	7.381.837	–	152.835.153	18.674.716	60.597.643
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	73.617.932	1.128.943	90.965.141	126.875	58.916	11.689.060	943.288	2.708.868
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		27.132.212	–	–	–	–	415.564	294	–
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		8.426.020	–	9.477.834	22.386	–	323.006	167.685	–
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	–	–	–	–	–	128.088
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		37.739.993	20.417	43.887.262	17.813	231	69.192	5.544	850.351
Vermögenswerte insgesamt		2.280.621.824	23.973.382	16.234.707.316	7.548.911	59.147	165.331.975	19.791.527	64.284.950
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	15.443.334	60.136	42.002.252	4.613.695	–	10.365	–	263.464
Kontenüberziehung	*4*	–	6.560	69.286	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		4.565.230	16.084	2.684.590	4.194	–	486.682	–	14.879
Antizipative Passiva		2.119.832	54.304	11.646.832	33.119	39.739	276.843	35.580	50.885
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		6.528.399	86	–	44	–	179.180	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		154.310	66.092	775.641	16.053	19.408	22.840	12.017	13.858
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		28.811.105	203.262	57.178.601	4.667.105	59.147	975.910	47.597	343.086
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		2.251.810.719	23.770.120	16.177.528.715	2.881.806	–	164.356.065	19.743.930	63.941.864

* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	Short Duration Emerging Market Debt Zum 31. Dezember 2023 US$	Short Duration High Yield SDG Engagement Zum 31. Dezember 2023 US$	Strategic Income Zum 31. Dezember 2023 US$	Sustainable Asia High Yield Zum 31. Dezember 2023 US$	Sustainable Emerging Market Corporate Debt Zum 31. Dezember 2023 US$	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Zum 31. Dezember 2023 US$	Tactical Macro Zum 31. Dezember 2023 US$	Ultra Short Term Euro Bond Zum 31. Dezember 2023 EUR
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	3.882.376.064	692.929.732	2.163.075.623	26.910.034	92.566.505	432.174.496	23.429.706	965.478.305
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	14.257.955	44.469.256	55.205.634	1.163.077	3.976.271	7.042.532	3.554.300	11.222.572
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		11.329.362	10.775.834	22.831.706	–	–	–	–	–
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		5.275.293	336.109	91.892.501	–	30.010	–	–	3.219.672
Forderungen gegenüber Brokern		5.350.000	–	22.631.176	108.311	425.554	4.811.634	526.958	11.144.095
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		51.967.946	11.302.348	16.507.617	513.607	1.463.373	7.824.139	6.453	10.766.896
Vermögenswerte insgesamt		3.970.556.620	759.813.279	2.372.144.257	28.695.029	98.461.713	451.852.801	27.517.417	1.001.831.540
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	9.131.675	3.114.085	25.175.764	58.767	472.118	5.706.695	262.401	8.016.867
Kontenüberziehung	*4*	–	–	377	–	–	–	68.223	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		2.760.383	241.544	3.405.075	746	28.695	16.636	–	440.357
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	520.000	–	–	–	–	–
Antizipative Passiva		2.320.930	510.397	1.529.024	58.670	146.162	215.044	10.585	258.073
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		1.500.740	11.465.702	321.393.124	–	–	90	93	–
Sonstige Verbindlichkeiten		73.325	47.104	517.312	11.895	25.601	22.066	13.807	243.945
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		15.787.053	15.378.832	352.540.676	130.078	672.576	5.960.531	355.109	8.959.242
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		3.954.769.567	744.434.447	2.019.603.581	28.564.951	97.789.137	445.892.270	27.162.308	992.872.298

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	Uncorrelated Strategies Zum 31. Dezember 2023 US$	Uncorrelated Trading Zum 31. Dezember 2023* US$	US Equity Zum 31. Dezember 2023 US$	US Equity Index PutWrite Zum 31. Dezember 2023 US$	US Large Cap Value Zum 31. Dezember 2023 US$	US Long Short Equity Zum 31. Dezember 2023 US$	US Multi Cap Opportunities Zum 31. Dezember 2023 US$	US Real Estate Securities Zum 31. Dezember 2023 US$
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	1.476.262.171	–	47.126.139	675.485.941	1.852.695.638	182.183.949	398.826.631	522.351.479
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	215.995.568	198.922	2.317.070	56.170.541	129.487.412	4.926.902	2.020.942	12.824.749
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		15.185.048	–	3.038	1.711.903	27.677.469	466.494	2.749.439	1.290.830
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		43.677.979	–	266.617	1.578.418	1.825.988	43.717	937.914	3.439.184
Forderungen gegenüber Brokern		456.802.391	–	–	–	–	18.176.471	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		76.645.645	1.324	37.095	1.742.599	2.702.827	559.458	211.780	1.534.038
Vermögenswerte insgesamt		2.284.568.802	200.246	49.749.959	736.689.402	2.014.389.334	206.356.991	404.746.706	541.440.280
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	499.958.213	–	118.963	5.789.899	115.827	8.738.101	325.170	441.683
Kontenüberziehung	*4*	659	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		4.375.209	–	349.690	1.255.511	11.729.299	692.205	3.342.769	6.007.211
Antizipative Passiva		1.133.015	110.069	74.355	349.539	1.158.780	280.090	547.484	895.622
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		81.242.292	–	–	165.070	62.146.829	14.013	–	941.735
Sonstige Verbindlichkeiten		71.157.993	90.177	4.802	31.383	48.221	1.162.291	39.248	44.044
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		657.867.381	200.246	547.810	7.591.402	75.198.956	10.886.700	4.254.671	8.330.295
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		1.626.701.421	–	49.202.149	729.098.000	1.939.190.378	195.470.291	400.492.035	533.109.985

* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	US Small Cap Zum 31. Dezember 2023 US$	US Small Cap Intrinsic Value Zum 31. Dezember 2023 US$	Fonds insgesamt* Zum 31. Dezember 2023 US$
Umlaufvermögen				
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	623.039.280	301.736.793	27.392.822.906
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	12.744.703	18.299.118	1.025.815.249
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		369	1.402.699	138.871.900
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		2.127.779	477.091	185.808.216
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	582.901.730
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		193.802	125.377	385.748.047
Vermögenswerte insgesamt		638.105.933	322.041.078	29.711.968.048
Kurzfristige Verbindlichkeiten				
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	137.144	398	688.709.657
Kontenüberziehung	*4*	–	–	563.542
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		3.284.597	40.900	72.180.295
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	3.340.000
Antizipative Passiva		639.284	275.610	22.069.430
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		154.493	140.859	517.779.908
Sonstige Verbindlichkeiten		38.646	14.694	82.992.460
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		4.254.164	472.461	1.387.635.292
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		633.851.769	321.568.617	28.324.332.756

Direktor:
Naomi Daly

Datum: 17. April 2024

Direktor:
Gráinne Alexander

Datum: 17. April 2024

* Der konsolidierte Abschluss wurde um im Namen des Fonds gehaltener Salden und um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	5G Connectivity Zum 31. Dezember 2022 US$	Absolute Return Multi Strategy Zum 31. Dezember 2022* US$	China A-Share Equity Zum 31. Dezember 2022 CNY	China Bond Zum 31. Dezember 2022 CNY	China Equity Zum 31. Dezember 2022 US$	CLO Income Zum 31. Dezember 2022 US$	Commodities Zum 31. Dezember 2022 US$	Corporate Hybrid Bond Zum 31. Dezember 2022 EUR
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	965.036.484	6.766	15.317.693	429.085.411	307.949.549	116.138.374	77.727.468	1.684.830.088
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	34.119.654	93.179	952.930	22.788.957	8.545.056	20.349.795	8.094.998	124.965.163
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		3.505.517	–	–	19.609.680	2.164.762	934	5.565.123	–
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		1.012.596	–	–	194	–	–	311.481	1.293.606
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	–	839.388	–	320.000	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		432.516	–	256.475	44.536.205	227	2.790.144	202.284	33.042.330
Vermögenswerte insgesamt		1.004.106.767	99.945	16.527.098	516.859.835	318.659.594	139.599.247	91.901.354	1.844.131.187
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	3.280.059	–	–	2.739.680	817.712	1.324.169	333.046	57.668.909
Kontenüberziehung	*4*	129	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		1.380.674	–	–	1.522.147	1.759	–	11.154	1.782.089
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	–	–	–	–	5.450.000	–
Antizipative Passiva		1.542.416	–	207.005	367.670	405.069	106.080	85.152	1.193.107
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		4.858.404	–	–	58.969.849	–	85.088	–	1.276.923
Sonstige Verbindlichkeiten		34.892	99.945	78.335	216.910	21.378	46.446	24.573	55.351
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		11.096.574	99.945	285.340	63.816.256	1.245.918	1.561.783	5.903.925	61.976.379
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		993.010.193	–	16.241.758	453.043.579	317.413.676	138.037.464	85.997.429	1.782.154.808

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	Emerging Market Debt - Hard Currency Zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Market Debt - Local Currency Zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Market Debt Blend Zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Markets Equity Zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Markets Select Equity Zum 31. Dezember 2022 US$	Euro Bond Zum 31.Dezember 2022 EUR	Euro Bond Absolute Return Zum 31. Dezember 2022 EUR
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	2.346.546.593	1.360.283.509	463.102.332	50.898.306	189.787.819	90.426.979	8.590.398	47.520.374
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	107.924.157	12.401.585	4.035.002	3.413.071	5.356.295	3.402.931	473.148	1.710.742
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	3.199.020	16.293.590	7.893	–	34.597	121.972	86.705
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		4.103.978	883.605	275.687	–	362.074	16.812	–	13.876.229
Forderungen gegenüber Brokern		3.276.177	54.984.796	9.999.389	424.677	–	–	258.450	252.313
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		59.709.417	30.010.757	11.304.641	746.361	550.079	193.164	102.378	435.363
Vermögenswerte insgesamt		2.521.560.322	1.461.763.272	505.010.641	55.490.308	196.056.267	94.074.483	9.546.346	63.881.726
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	11.868.883	57.448.294	13.780.086	542.408	666.859	–	112.447	1.279.616
Kontenüberziehung	*4*	–	–	–	12	345	–	–	388
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		14.282.774	1.482.933	621.342	1.033	2.563.061	577	–	13.827.198
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	3.980.000	840.000	–	–	–	–	–
Antizipative Passiva		2.024.113	1.301.053	469.534	63.835	289.525	124.746	34.664	51.536
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		1.572.454	2.187.526	1.940.067	499.247	38.266	40.672	17.717	46.881
Sonstige Verbindlichkeiten		107.170	9.099.023	17.178.132	109.392	690.456	146.366	86.776	148.231
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		29.855.394	75.498.829	34.829.161	1.215.927	4.248.512	312.361	251.604	15.353.850
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		2.491.704.928	1.386.264.443	470.181.480	54.274.381	191.807.755	93.762.122	9.294.742	48.527.876

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	European High Yield Bond Zum 31. Dezember 2022 EUR	European Sustainable Equity Zum 31. Dezember 2022 EUR	Event Driven Zum 31. Dezember 2022 US$	Global Bond Zum 31. Dezember 2022 US$	Global Diversified Income FMP – 2024 Zum 31. Dezember 2022 US$	Global Equity Megatrends Zum 31. Dezember 2022 US$	Global Flexible Credit Income Zum 31. Dezember 2022 US$	Global SDG Engagement Zum 31.Dezember 2022 US$
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	33.741.184	174.388.827	34.759.787	133.785.619	154.791.860	79.465.335	385.148.567	286.905.751
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	1.372.196	1.487.612	6.873.963	4.700.090	50.248.991	77.732	10.118.861	5.259.514
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2	–	–	834.394	–	–	154.968	71.005
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		13.705.182	5.007.586	–	–	–	40.452	9.991	123.184.909
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	–	376.572	–	–	5.284.784	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		544.743	172.097	8.601	867.942	1.581.894	115.036	6.555.070	5.725.188
Vermögenswerte insgesamt		49.363.307	181.056.122	41.642.351	140.564.617	206.622.745	79.698.555	407.272.241	421.146.367
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	3.113.019	–	18.616	2.112.792	417	–	12.005.976	9.426.254
Kontenüberziehung	*4*	–	–	–	–	–	–	–	15
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		13.707.154	3.727.664	–	–	46.050.000	134.741	28.122	144.749
Antizipative Passiva		50.457	134.129	76.524	65.484	167.100	188.716	280.150	120.597
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		20.048	1.319.645	–	3.505.750	–	37	352.483	74.390.132
Sonstige Verbindlichkeiten		18.101	20.454	100.539	69.295	9.142	30.696	79.181	111.242
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		16.908.779	5.201.892	195.679	5.753.321	46.226.659	354.190	12.745.912	84.192.989
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		32.454.528	175.854.230	41.446.672	134.811.296	160.396.086	79.344.365	394.526.329	336.953.378

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	Global High Yield Sustainable Action Zum 31. Dezember 2022 US$	Global Investment Grade Credit Zum 31. Dezember 2022 US$	Global Opportunistic Bond Zum 31. Dezember 2022 US$	Global Real Estate Securities Zum 31. Dezember 2022 US$	Global Sustainable Equity Zum 31. Dezember 2022 US$	Global Nachhaltig Wert Zum 31.Dezember 2022 US$	High Yield Bond Zum 31. Dezember 2022 US$	InnovAsia 5G Zum 31. Dezember 2022 US$
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	14.547.172	83.541.497	80.110.952	38.072.868	130.524.482	47.841.138	2.170.021.483	14.325.847
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	1.033.221	3.565.231	5.863.263	1.125.241	1.070.714	727.506	134.476.435	596.336
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		253	–	406.959	13	–	270.540	4.627.097	41.445
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		–	–	14	–	4.411.790	3.427	3.517.926	–
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	1.228.672	–	–	–	300.000	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		279.956	882.351	908.005	119.762	91.089	113.386	38.784.027	69.903
Vermögenswerte insgesamt		15.860.602	87.989.079	88.517.865	39.317.884	136.098.075	48.955.997	2.351.726.968	15.033.531
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	358.029	1.642.819	5.529.567	147.763	–	90.456	25.597.669	78.732
Kontenüberziehung	*4*	–	–	–	86	–	–	149	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		–	–	30	69.724	4.397.123	727.660	5.887.375	32.016
Antizipative Passiva		40.994	90.568	75.034	58.301	116.088	55.463	2.442.382	103.033
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		406.264	–	6.676.859	–	7	152	18.780.475	48.481
Sonstige Verbindlichkeiten		8.247	347.050	130.932	19.590	6.658	57.825	267.206	22.276
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		813.534	2.080.437	12.412.422	295.464	4.519.876	931.556	52.975.256	284.538
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		15.047.068	85.908.642	76.105.443	39.022.420	131.578.199	48.024.441	2.298.751.712	14.748.993

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	Japan Equity Engagement Zum 31. Dezember 2022 JPY	Macro Opportunities FX Zum 31. Dezember 2022 EUR	Multi-Asset Income Zum 31. Dezember 2022 US$	Next Generation Mobility Zum 31. Dezember 2022 US$	Next Generation Space Economy Zum 31. Dezember 2022 US$	Responsible Asian Debt -Hard Currency Zum 31.Dezember 2022 US$	Short Duration Emerging Market Debt Zum 31. Dezember 2022 US$	Short Duration High Yield SDG Engagement Zum 31. Dezember 2022 US$
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	20.251.986.644	35.753.350	9.231.268	138.694.644	7.981.674	20.262.516	4.901.636.040	536.260.884
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	421.921.338	131.107	1.795.321	9.717.383	555.274	1.180.261	196.555.616	27.853.758
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	67	284.261	72.621	–	–	11.003	56.462
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		–	66.778	67.840	279.664	19.545	–	9.283.967	2.421.432
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	628.167	–	–	55.253	–	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		28.870.308	107.020	189.122	53.143	13.778	299.519	77.069.801	7.908.182
Vermögenswerte insgesamt		20.702.778.290	36.058.322	12.195.979	148.817.455	8.570.271	21.797.549	5.184.556.427	574.500.718
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	141.215.249	4.428.576	647.046	213.661	–	88.173	25.830.013	5.286.451
Kontenüberziehung	*4*	98.494	–	3.963	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		–	51.700	–	79.879	–	18.123	7.657.731	3.628.199
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	–	–	–	–	–	–
Antizipative Passiva		12.310.780	48.457	74.442	279.259	42.290	43.612	3.062.519	411.720
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		5.076.179	–	67.370	216.677	23.001	–	23.342.727	8.756.374
Sonstige Verbindlichkeiten		1.410.003	19.433	37.043	23.302	14.118	21.432	1.687	44.295
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		160.110.705	4.548.166	829.864	812.778	79.409	171.340	59.894.677	18.127.039
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		20.542.667.585	31.510.156	11.366.115	148.004.677	8.490.862	21.626.209	5.124.661.750	556.373.679

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	Strategic Income Zum 31.Dezember 2022 US$	Sustainable Asia High Yield Zum 31. Dezember 2022 US$	Sustainable Emerging Market Corporate Debt Zum 31. Dezember 2022 US$	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Zum 31. Dezember 2022 US$	Ultra Short Term Euro Bond Zum 31. Dezember 2022 EUR	Uncorrelated Strategies Zum 31. Dezember 2022 US$	Uncorrelated Trading Zum 31. Dezember 2022 US$	US Equity Zum 31.Dezember 2022 US$
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	1.454.526.951	28.628.399	92.287.239	147.618.248	808.942.173	2.555.941.719	598.691.431	29.642.109
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	104.978.500	2.770.190	6.953.109	8.625.196	10.039.473	301.147.318	66.208.500	2.395.266
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		34.551.202	–	–	6.851	7.615	84.079.197	25.143.028	–
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		5.263.162	–	198.096	2.755.712	606.680	10.881.609	303.985	7.971
Forderungen gegenüber Brokern		3.722.665	58.035	166.695	199.602	6.612.268	737.006.142	89.712.105	–
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		13.288.492	679.979	1.542.219	3.029.425	7.293.900	228.604.888	19.269.949	25.906
Vermögenswerte insgesamt		1.616.330.972	32.136.603	101.147.358	162.235.034	833.502.109	3.917.660.873	799.328.998	32.071.252
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	13.465.056	29.229	141.962	908.488	10.569.827	489.983.868	59.324.225	546.931
Kontenüberziehung	*4*	155	–	1.508.656	–	–	22.735	27.694	–
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		3.707.806	–	177.478	2.726.126	322.425	2.890.689	223.254	–
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		250.000	–	–	–	–	5.000	63.659	–
Antizipative Passiva		1.089.994	70.771	149.274	117.559	257.172	2.108.050	1.477.266	47.361
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		274.300.844	85.047	809.961	–	608.123	126.044.433	14.876.428	–
Sonstige Verbindlichkeiten		711.262	29.285	115.719	62.267	354.495	166.119.116	11.393.762	12.131
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		293.525.117	214.332	2.903.050	3.814.440	12.112.042	787.173.891	87.386.288	606.423
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		1.322.805.855	31.922.271	98.244.308	158.420.594	821.390.067	3.130.486.982	711.942.710	31.464.829

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Bilanzen (Fortsetzung)

	Anm.	US Equity Index PutWrite Zum 31. Dezember 2022 US$	US Large Cap Value Zum 31. Dezember 2022 US$	US Long Short Equity Zum 31. Dezember 2022 US$	US Multi Cap Opportunities Zum 31. Dezember 2022 US$	US Real Estate Securities Zum 31. Dezember 2022 US$	US Small Cap Zum 31. Dezember 2022 US$	US Small Cap Intrinsic Value Zum 31. Dezember 2022 US$	Fonds insgesamt* Zum 31. Dezember 2022 US$
Umlaufvermögen									
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	648.856.403	1.689.599.584	179.143.690	441.762.007	628.621.129	579.729.131	186.889.372	27.511.074.629
Barmittel und Barmitteläquivalente	*3*	44.491.927	75.198.123	34.444.171	1.259.174	21.884.190	10.674.691	8.840.096	1.518.644.441
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		3.987.199	17.011.441	8.813.281	2.155.112	96	109.183	1.398.733	217.909.539
Forderungen aus ausgegebenen Anteilen		567.528	5.505.395	289.671	823.707	3.580.698	1.178.559	491.844	217.511.029
Forderungen gegenüber Brokern		–	–	11.644.215	–	–	–	–	927.110.748
Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen		379.288	1.854.555	891.436	219.477	1.956.405	2.524.308	66.145	573.072.046
Vermögenswerte insgesamt		698.282.345	1.789.169.098	235.226.464	446.219.477	656.042.518	594.215.872	197.686.190	30.965.322.432
Kurzfristige Verbindlichkeiten									
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	*2*	14.283.196	102.612	2.889.863	587.402	1.230.032	236.699	–	846.692.109
Kontenüberziehung	*4*	–	–	–	–	–	–	–	1.565.099
Verbindlichkeiten aus zurückgenommenen Anteilen		543.568	494.764	1.227.732	1.019.084	3.412.368	780.783	287.203	142.576.198
Verbindlichkeiten gegenüber dem Makler		–	–	–	–	–	–	–	10.588.659
Antizipative Passiva		366.712	1.065.730	329.297	631.626	1.318.524	654.722	196.002	25.893.180
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		2.608.050	19.542.707	91.888	2.618.414	1.982.404	129.484	2.170.492	605.080.476
Sonstige Verbindlichkeiten		24.081	8.926	9.157.783	47.001	73.395	35.517	991.453	218.544.490
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)		17.825.607	21.214.739	13.696.563	4.903.527	8.016.723	1.837.205	3.645.150	1.850.940.211
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen		680.456.738	1.767.954.359	221.529.901	441.315.950	648.025.795	592.378.667	194.041.040	29.114.382.221

* Der konsolidierte Abschluss wurde um im Namen des Fonds gehaltener Salden und um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen

	Anm.	5G Connectivity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Absolute Return Multi Strategy Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023* US$	China A-Share Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 CNY	China Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 CNY	China Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Climate Innovation Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023** US$	CLO Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Commodities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Erträge									
Zinserträge	*1*	1.613.265	4.700	191	14.012.501	118.367	2.722	16.251.994	3.172.776
Dividendenerträge	*1*	5.844.061	12.860	330.323	–	5.998.152	7.825	488.555	–
Sonstige Erträge		–	1.832	–	–	261	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	342.688.178	(19.392)	(2.078.125)	24.887.406	(65.385.007)	(83.333)	15.296.714	(9.444.949)
		350.145.504	–	(1.747.611)	38.899.907	(59.268.227)	(72.786)	32.037.263	(6.272.173)
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	14.117.852	–	141.677	255.294	3.175.628	112	872.722	438.730
Vertriebsgebühren	*6*	647.325	–	–	–	183	–	–	2.462
Verwaltungsgebühren	*6*	591.471	–	284.983	564.899	165.356	12.359	111.751	99.444
Bereitstellungsprovision	*19*	187.549	–	2.284	49.489	38.821	93	20.130	15.833
Depotgebühren	*6*	132.274	–	85.543	247.855	61.993	2.503	12.061	12.000
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	60.619	–	898	26.749	15.891	29	8.035	6.800
Honorare	*9*	239.594	–	373.292	551.080	137.367	12.320	77.913	59.473
Honorare der Direktoren	*7*	4.813	–	31.072	30.759	4.351	1.375	4.436	4.416
Transaktionskosten	*9*	2.027.737	–	182.302	104.430	473.178	13.023	38.730	40.645
Gründungsaufwendungen	*9*	–	–	–	–	–	32.730	–	–
Prüfungshonorare	*8*	12.024	–	74.507	75.617	10.793	10.779	10.872	10.688
Umsatzsteuerentlastung		(6.953)	–	(111)	(4.238)	(1.811)	(1)	(1.085)	(871)
Sonstige Aufwendungen	*9*	29.234	–	63.082	181.289	18.825	327	8.112	12.060
Kostenverzicht	*6*	–	–	(1.006.693)	(722.214)	–	(52.175)	–	(37.378)
Aufwendungen insgesamt		18.043.539	–	232.836	1.361.009	4.100.575	33.474	1.163.677	664.302
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		641	–	–	8.419	–	–	–	–
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	–	–	15.082	222.140	3.216	–	9.174.149	–
		641	–	15.082	230.559	3.216	–	9.174.149	–
Quellensteuern	*1*	1.253.704	–	32.397	19.376	413.387	1.185	–	–
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		330.847.620	–	(2.027.926)	37.288.963	(63.785.405)	(107.445)	21.699.437	(6.936.475)

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.
** Der Climate Innovation wurde am 1. August 2023 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	Corporate Hybrid Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	Developed Market FMP – 2027 Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* US$	Emerging Market Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Market Debt - Local Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Market Debt Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Markets Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Markets Select Equity Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023** US$
Erträge									
Zinserträge	*1*	78.046.057	2.080.257	142.794.885	74.404.513	26.990.410	2.739.189	199.109	168.843
Dividendenerträge	*1*	–	–	–	113.951	171.675	–	2.885.513	1.307.641
Sonstige Erträge		–	–	–	1.161.393	310.983	7.843	131	4.097
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	76.398.634	3.758.602	211.428.520	98.021.149	36.380.307	1.250.394	9.999.988	2.658.863
		154.444.691	5.838.859	354.223.405	173.701.006	63.853.375	3.997.426	13.084.741	4.139.444
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	11.575.142	276.626	18.716.353	8.682.808	3.275.391	288.809	1.251.833	506.150
Vertriebsgebühren	*6*	188.575	–	257.674	211.184	27.982	–	38.630	–
Verwaltungsgebühren	*6*	786.884	25.844	1.322.602	776.349	390.982	115.789	194.084	62.348
Bereitstellungsprovision	*19*	255.784	4.051	359.881	182.049	70.533	8.546	23.159	11.942
Depotgebühren	*6*	120.929	2.686	187.281	821.231	166.826	14.472	62.279	42.088
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	84.817	1.200	121.595	46.840	30.217	3.067	8.287	3.520
Honorare	*9*	299.200	12.476	429.692	320.609	168.668	39.476	170.898	63.180
Honorare der Direktoren	*7*	3.805	1.375	4.350	4.345	4.615	4.346	4.351	3.502
Transaktionskosten	*9*	85.505	876	355.940	456.525	258.261	80.894	860.872	408.555
Gründungsaufwendungen	*9*	–	31.982	–	–	–	–	–	–
Prüfungshonorare	*8*	10.993	10.960	12.130	12.363	12.240	10.239	10.756	11.886
Umsatzsteuerentlastung		(15.890)	(62)	(23.123)	(11.635)	(4.408)	(503)	(1.214)	(472)
Sonstige Aufwendungen	*9*	8.913	327	10.300	25.954	22.095	8.703	11.602	9.105
Kostenverzicht	*6*	–	(151)	–	(107.151)	(7.876)	(150.355)	(246.700)	(75.080)
Aufwendungen insgesamt		13.404.657	368.190	21.754.675	11.421.471	4.415.526	423.483	2.388.837	1.046.724
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		136.189	225	807	38.492	9.326	4.222	1.315	–
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	15.938.833	–	34.774.185	19.776.443	5.146.481	–	211.792	–
		16.075.022	225	34.774.992	19.814.935	5.155.807	4.222	213.107	–
Quellensteuern	*1*	–	13.414	2.125	561.616	98.515	25.749	317.037	176.255
Kapitalertragsteuer	*1*	–	–	–	190.222	5.295	5.491	602.394	153.572
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		124.965.012	5.457.030	297.691.613	141.712.762	54.178.232	3.538.481	9.563.366	2.762.893

* Der Developed Market FMP – 2027 wurde am 31. Juli 2023 aufgelegt.
** Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	Euro Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	Euro Bond Absolute Return Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	European High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	European Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	Event Driven Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Diversified Income FMP – 2024 Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Equity Megatrends Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Erträge									
Zinserträge	*1*	299.445	1.325.303	6.144.081	46.810	531.326	4.814.163	6.583.236	66.717
Dividendenerträge	*1*	–	–	–	2.466.485	–	–	–	1.360.692
Sonstige Erträge		3.353	9.632	–	–	–	6.489	–	6.969
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	703.906	1.706.179	17.258.206	29.777.265	9.605.231	2.834.548	3.455.573	20.285.551
		1.006.704	3.041.114	23.402.287	32.290.560	10.136.557	7.655.200	10.038.809	21.719.929
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	34.123	41.625	192.591	518.724	419.803	10.546	897.634	1.330.600
Vertriebsgebühren	*6*	–	–	4.027	341	–	5.754	–	259.499
Verwaltungsgebühren	*6*	57.348	74.539	138.341	108.783	70.949	173.685	107.262	121.770
Bereitstellungsprovision	*19*	1.380	6.436	11.429	23.096	9.340	19.346	22.929	14.348
Depotgebühren	*6*	11.095	10.943	10.994	20.847	10.672	12.232	12.000	12.097
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	551	2.475	5.939	9.116	2.953	7.665	9.030	5.585
Honorare	*9*	30.275	36.460	81.370	65.478	93.976	70.705	80.075	66.380
Honorare der Direktoren	*7*	4.346	4.349	3.759	3.967	3.597	4.351	4.378	4.359
Erfolgsabhängige Gebühr	*6*	–	–	–	–	1.269.230	–	–	–
Transaktionskosten	*9*	13.533	31.654	26.386	151.518	25.962	94.888	4.942	64.743
Prüfungshonorare	*8*	8.724	9.033	10.491	9.604	11.071	10.000	10.890	10.442
Umsatzsteuerentlastung		(89)	(397)	(746)	(1.330)	(695)	(1.185)	(1.109)	(768)
Sonstige Aufwendungen	*9*	9.077	9.077	11.095	8.742	–	9.560	6.978	21.064
Kostenverzicht	*6*	(113.220)	(84.716)	(49.387)	–	(80.167)	(99.791)	–	(2)
Aufwendungen insgesamt		57.143	141.478	446.289	918.886	1.836.691	317.756	1.155.009	1.910.117
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		49	2.740	336	58	160	373	–	1.660
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	198.317	160	57.021	1.048.292	–	2.390	3.747.714	–
		198.366	2.900	57.357	1.048.350	160	2.763	3.747.714	1.660
Quellensteuern	*1*	–	–	24.070	386.738	4.281	46.961	738	207.790
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		751.195	2.896.736	22.874.571	29.936.586	8.295.425	7.287.720	5.135.348	19.600.362

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	Global Flexible Credit Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global SDG Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global High Yield Sustainable Action Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* US$	Global Investment Grade Credit Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Opportunistic Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Sustainable Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Erträge									
Zinserträge	*1*	21.820.785	30.627.441	381.879	3.526.734	2.880.171	39.396	58.764	13.338
Dividendenerträge	*1*	21.240	–	–	–	6.726	1.264.200	1.296.585	1.502.022
Sonstige Erträge		84.242	38.129	–	–	46.306	–	–	4.516
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	35.644.061	26.225.288	301.287	4.608.966	1.814.974	305.309	30.786.664	6.863.427
		57.570.328	56.890.858	683.166	8.135.700	4.748.177	1.608.905	32.142.013	8.383.303
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	1.581.714	1.820.214	36.223	45.379	107.580	223.249	385.849	120.957
Vertriebsgebühren	*6*	48.797	7.284	–	–	–	18.013	3.636	4.224
Verwaltungsgebühren	*6*	203.139	338.869	70.047	105.600	160.902	81.792	110.846	79.855
Bereitstellungsprovision	*19*	50.956	69.680	1.194	13.918	9.516	4.522	18.864	5.675
Depotgebühren	*6*	12.177	16.554	6.000	11.989	12.081	12.000	12.000	11.965
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	20.039	26.984	462	6.727	3.502	1.742	7.898	2.558
Honorare	*9*	81.067	133.872	38.938	4.017	57.834	71.086	70.149	64.011
Honorare der Direktoren	*7*	4.358	4.347	2.387	4.075	4.352	4.545	4.378	4.546
Transaktionskosten	*9*	73.004	133.254	2.818	5.693	81.558	90.308	42.340	116.303
Prüfungshonorare	*8*	17.347	11.736	10.617	10.304	10.636	10.663	10.686	10.598
Umsatzsteuerentlastung		(2.430)	(4.135)	(44)	(625)	(641)	(313)	(1.027)	(429)
Sonstige Aufwendungen	*9*	10.197	10.004	5.115	8.276	9.387	9.598	12.831	9.043
Kostenverzicht	*6*	–	(159.267)	(122.957)	(43.306)	(181.897)	(134.867)	–	(84.092)
Verzicht auf Gebühren	*6*	(1.719)	–	–	–	(544)	–	–	–
Aufwendungen insgesamt		2.098.646	2.409.396	50.800	172.047	274.266	392.338	678.450	345.214
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		471	6	29	101	346	182	909	211
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	18.040	364.914	289.047	–	309.334	290.893	–	–
		18.511	364.920	289.076	101	309.680	291.075	909	211
Quellensteuern	*1*	72.578	–	–	7.061	5.267	253.104	335.347	300.594
Kapitalertragsteuer	*1*	–	–	–	–	–	–	–	1.449
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		55.380.593	54.116.542	343.290	7.956.491	4.158.964	672.388	31.127.307	7.735.835

* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	InnovAsia 5G Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Japan Equity Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 JPY	Macro Opportunities FX Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	Multi-Asset Income Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* US$	Next Generation Mobility Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Next Generation Space Economy Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Responsible Asian Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Erträge									
Zinserträge	*1*	149.097.884	35.914	–	143.684	152.535	532.771	28.764	2.331.729
Dividendenerträge	*1*	1.147.749	254.715	476.921.443	–	78.340	1.435.123	147.664	600
Sonstige Erträge		528.115	–	–	–	185	–	–	1.882
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	108.102.355	5.319.099	4.688.235.837	(734.342)	122.062	41.427.145	3.285.903	919.735
		258.876.103	5.609.728	5.165.157.280	(590.658)	353.122	43.395.039	3.462.331	3.253.946
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	19.351.744	204.049	76.940.068	119.567	67.102	2.204.012	117.126	27.705
Vertriebsgebühren	*6*	1.677.140	348	–	–	16.289	365.864	21.123	3.810
Verwaltungsgebühren	*6*	1.505.292	74.353	15.508.873	69.483	87.657	140.494	27.041	95.572
Bereitstellungsprovision	*19*	316.037	2.736	3.341.855	3.874	765	23.493	1.848	6.569
Depotgebühren	*6*	30.472	12.000	2.954.075	11.374	6.762	11.000	12.000	12.068
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	126.175	1.470	1.182.736	1.348	373	7.948	335	2.701
Honorare	*9*	520.499	39.126	9.102.401	39.056	56.605	91.573	30.501	129.559
Honorare der Direktoren	*7*	4.642	3.386	618.801	4.126	2.529	4.345	4.416	4.297
Transaktionskosten	*9*	238.123	147.113	33.260.732	52.959	49.317	44.253	23.035	12.406
Prüfungshonorare	*8*	19.031	10.959	1.473.796	9.246	11.336	11.031	10.191	10.696
Umsatzsteuerentlastung		(16.779)	(146)	(185.968)	(203)	(70)	(1.398)	(103)	(490)
Sonstige Aufwendungen	*9*	10.674	5.469	1.632.029	8.734	9.625	11.418	13.171	10.364
Kostenverzicht	*6*	–	(165.298)	–	(147.827)	(209.946)	–	(91.899)	(196.965)
Verzicht auf Gebühren	*6*	(92.880)	–	–	–	–	–	–	–
Aufwendungen insgesamt		23.690.170	335.565	145.829.398	171.737	98.344	2.914.033	168.785	118.292
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		602	79	26.240	683	4.261	–	–	49
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	90.271.905	–	111.381.658	5	6.037	–	–	384.726
		90.272.507	79	111.407.898	688	10.298	–	–	384.775
Quellensteuern	*1*	436.171	39.727	71.821.634	–	7.307	277.297	23.993	51
Kapitalertragsteuer	*1*	–	(6.993)	–	–	709	–	–	–
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		144.477.255	5.241.350	4.836.098.350	(763.083)	236.464	40.203.709	3.269.553	2.750.828

* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	Short Duration Emerging Market Debt Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Short Duration High Yield SDG Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Strategic Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Sustainable Asia High Yield Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Sustainable Emerging Market Corporate Debt Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Tactical Macro Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* US$	Ultra Short Term Euro Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR
Erträge									
Zinserträge	*1*	191.792.317	42.661.844	65.553.584	1.607.195	4.991.771	17.467.146	166.723	22.390.554
Dividendenerträge	*1*	–	76.604	46.343	–	1.800	–	–	–
Sonstige Erträge		–	113.328	112.776	–	–	–	9	120.772
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	165.739.545	10.878.844	61.142.662	(630.224)	4.754.214	25.660.200	608.249	37.931.029
		357.531.862	53.730.620	126.855.365	976.971	9.747.785	43.127.346	774.981	60.442.355
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	25.136.609	4.340.741	11.003.160	5.539	687.958	1.328.504	128	1.387.733
Vertriebsgebühren	*6*	709.836	93.159	1.010.946	–	29.988	–	–	4.291
Verwaltungsgebühren	*6*	1.974.927	451.107	1.035.461	62.317	142.217	165.181	10.991	415.569
Bereitstellungsprovision	*19*	665.780	93.653	214.865	4.798	12.902	44.239	901	122.389
Depotgebühren	*6*	332.711	11.823	41.717	12.000	11.659	25.904	3.056	65.319
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	212.190	37.315	85.112	2.538	5.415	19.363	317	47.746
Honorare	*9*	675.369	223.122	313.343	68.178	100.875	29.187	28.467	146.359
Honorare der Direktoren	*7*	4.793	4.351	4.334	4.416	4.351	4.416	1.849	3.874
Transaktionskosten	*9*	164.417	78.566	406.719	7.339	38.710	68.273	10.264	79.640
Gründungsaufwendungen	*9*	–	–	–	–	–	–	31.982	–
Prüfungshonorare	*8*	13.674	13.597	–	10.286	12.055	10.487	9.698	9.691
Umsatzsteuerentlastung		(41.069)	(5.980)	(13.815)	(207)	(876)	(3.062)	(13)	(8.025)
Sonstige Aufwendungen	*9*	11.556	8.457	7.962	13.150	9.348	8.515	2.527	8.586
Kostenverzicht	*6*	–	–	–	(138.167)	(168.791)	(3.326)	(42.137)	–
Verzicht auf Gebühren	*6*	–	(6.199)	(3.750)	–	–	–	–	–
Aufwendungen insgesamt		29.860.793	5.343.712	14.106.054	52.187	885.811	1.697.681	58.030	2.283.172
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		1.763	–	2.784	–	1.363	206	532	–
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	51.357.229	10.256.963	24.092.142	375.442	203.460	–	–	70.519
		51.358.992	10.256.963	24.094.926	375.442	204.823	206	532	70.519
Quellensteuern	*1*	–	39.788	432.402	7.915	235	253.923	–	–
Kapitalertragsteuer	*1*	–	–	(1.377)	–	–	–	–	–
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		276.312.077	38.090.157	88.223.360	541.427	8.656.916	41.175.536	716.419	58.088.664

* Der Tactical Macro wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	Uncorrelated Strategies Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Uncorrelated Trading Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* US$	US Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Equity Index PutWrite Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Large Cap Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Long Short Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Multi Cap Opportunities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Erträge									
Zinserträge	*1*	39.173.095	3.569.936	66.021	7.387.106	3.516.594	2.214.827	76.721	787.359
Dividendenerträge	*1*	–	–	367.740	–	51.415.915	2.138.898	4.926.517	21.216.873
Sonstige Erträge		–	8.248	91	–	–	–	24.292	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	(120.381.469)	(12.687.726)	9.122.314	107.636.527	(71.805.012)	27.101.438	70.024.943	40.971.227
		(81.208.374)	(9.109.542)	9.556.166	115.023.633	(16.872.503)	31.455.163	75.052.473	62.975.459
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	15.768.031	2.845.723	274.888	2.839.436	10.553.183	2.806.305	4.999.948	7.539.332
Beratungsgebühren	*6*	17.684.684	–	–	–	–	–	–	–
Vertriebsgebühren	*6*	147.327	–	15.793	11.469	271.013	33.182	427.679	1.168.862
Verwaltungsgebühren	*6*	2.988.157	347.786	62.733	358.913	881.818	183.718	371.095	597.879
Bereitstellungsprovision	*19*	360.886	54.101	5.066	91.827	284.218	36.599	58.199	79.342
Depotgebühren	*6*	269.480	62.274	11.931	12.023	28.415	12.001	11.999	11.435
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	245.133	45.183	1.972	32.487	110.626	8.475	23.513	27.347
Honorare	*9*	1.004.200	68.646	43.779	180.390	326.808	111.907	188.172	219.239
Honorare der Direktoren	*7*	4.626	2.397	4.544	4.012	4.416	4.550	4.779	4.352
Erfolgsabhängige Gebühr	*6*	–	–	–	–	–	284.324	–	–
Transaktionskosten	*9*	15.052.935	1.040.744	14.565	116.951	981.117	114.629	204.132	406.687
Prüfungshonorare	*8*	10.345	9.096	9.938	11.147	11.012	11.208	12.169	12.731
Umsatzsteuerentlastung		(17.461)	(1.707)	(347)	(6.201)	(15.584)	(1.977)	(3.717)	(5.129)
Sonstige Aufwendungen	*9*	5.336.209	287.263	8.895	8.582	19.767	11.593	9.681	10.176
Kostenverzicht	*6*	(30.083)	(155.312)	(72.815)	–	–	–	–	–
Aufwendungen insgesamt		58.824.469	4.606.194	380.942	3.661.036	13.456.809	3.616.514	6.307.649	10.072.253
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		170.739	82.590	1.581	–	–	3.963	1.130	–
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	–	–	–	1.591.989	10.005.741	206.378	12.800	4.675.054
		170.739	82.590	1.581	1.591.989	10.005.741	210.341	13.930	4.675.054
Quellensteuern	*1*	8.614.771	367.188	107.017	–	14.056.234	628.112	1.411.773	5.817.425
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(148.818.353)	(14.165.514)	9.066.626	109.770.608	(54.391.287)	27.000.196	67.319.121	42.410.727

* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	US Small Cap Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Small Cap Intrinsic Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Fonds insgesamt* Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Erträge				
Zinserträge	*1*	507.554	977.188	995.771.322
Dividendenerträge	*1*	6.044.808	1.760.459	119.445.636
Sonstige Erträge		43.524	–	2.650.276
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	86.161.892	34.297.130	1.584.823.295
		92.757.778	37.034.777	2.702.690.529
Aufwendungen				
Managementgebühr	*6*	5.957.709	2.190.026	194.432.180
Beratungsgebühren	*6*	–	–	17.684.684
Vertriebsgebühren	*6*	191.973	4.501	7.946.225
Verwaltungsgebühren	*6*	406.184	180.153	19.659.563
Bereitstellungsprovision	*19*	90.926	36.673	4.139.264
Depotgebühren	*6*	11.971	11.950	2.966.123
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	27.463	14.201	1.615.560
Honorare	*9*	215.352	96.440	8.275.274
Honorare der Direktoren	*7*	4.351	4.416	234.165
Erfolgsabhängige Gebühr	*6*	–	–	1.553.554
Transaktionskosten	*9*	239.541	99.564	26.064.424
Gründungsaufwendungen	*9*	–	–	96.694
Prüfungshonorare	*8*	11.044	10.448	627.861
Umsatzsteuerentlastung		(5.515)	(2.289)	(240.259)
Sonstige Aufwendungen	*9*	12.865	20.882	6.232.386
Kostenverzicht	*6*	–	–	(3.529.280)
Verzicht auf Gebühren	*6*	–	–	(105.092)
Aufwendungen insgesamt		7.163.864	2.666.965	287.653.326
Finanzierungskosten				
Zinsaufwendungen		1.960	–	485.899
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	–	–	287.094.911
		1.960	–	287.580.810
Quellensteuern	*1*	1.757.033	458.379	39.795.504
Kapitalertragsteuer	*1*	–	–	950.762
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		83.834.921	33.909.433	2.086.710.127

Alle Erträge und Aufwendungen ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit – mit Ausnahme des Absolute Return Multi Strategy, Emerging Markets Select Equity, Global High Yield Sustainable Action, Multi-Asset Income, Uncorrelated Trading und Macro Opportunities FX, die am 20. Dezember 2021, 7. September 2023, 16. Juni 2023, 6. Juli 2023, 24. Mai 2023 bzw. 8. Februar 2024 aufgelöst wurden. Außer den in der konsolidierten Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne und Verluste im Geschäftsjahr.

* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	5G Connectivity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Absolute Return Multi Strategy Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022* US$	China A-Share Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 CNY	China Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 CNY	China Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	CLO Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Commodities Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022** US$	Corporate Hybrid Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR
Erträge									
Zinserträge	*1*	508.120	5.657	5	17.550.832	30.119	11.114.425	761.052	79.295.541
Dividendenerträge	*1*	7.178.948	4.375	292.013	–	10.269.050	–	–	–
Erträge aus der Wertpapierleihe	*18*	–	–	–	–	–	–	–	58.183
Sonstige Erträge		–	11.709	–	181.398	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	(941.839.697)	(20.585)	(5.711.132)	(22.887.822)	(118.823.844)	(27.050.224)	(2.014.541)	(361.963.166)
		(934.152.629)	1.156	(5.419.114)	(5.155.592)	(108.524.675)	(15.935.799)	(1.253.489)	(282.609.442)
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	19.318.527	–	178.248	933.339	4.936.192	754.722	215.308	13.032.178
Vertriebsgebühren	*6*	712.648	–	–	–	245.552	–	1.855	234.871
Verwaltungsgebühren	*6*	886.958	–	184.996	507.602	212.517	90.685	56.244	938.540
Bereitstellungsprovision	*19*	31.352	–	2.947	147.157	57.652	18.464	1.214	280.396
Depotgebühren	*6*	178.402	–	60.522	348.069	96.429	11.978	10.714	146.044
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	69.708	–	990	26.990	19.916	6.763	1.977	100.979
Honorare	*9*	231.415	–	410.382	425.712	85.740	34.913	78.404	177.179
Honorare der Direktoren	*7*	4.413	–	26.679	25.027	6.008	4.413	4.511	4.290
Transaktionskosten	*9*	4.063.843	–	78.836	383.773	614.068	9.785	5.685	92.938
Gründungsaufwendungen	*9*	–	–	–	–	–	852	33.630	–
Prüfungshonorare	*8*	5.197	–	50.136	–	4.500	6.049	9.775	5.637
Umsatzsteuerentlastung		(9.178)	(6)	(130)	(2.854)	(2.644)	(860)	(337)	(9.907)
Sonstige Aufwendungen	*9*	38.111	315	59.626	43.742	19.417	5	4.607	7.354
Kostenverzicht	*6*	–	–	(837.096)	(411.916)	–	–	(68.886)	–
Aufwendungen insgesamt		25.531.396	309	216.136	2.426.641	6.295.347	937.769	354.701	15.010.499
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		6.766	27	–	92	–	77	3.364	90
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	–	–	–	1.637.507	3.567	7.260.183	–	14.808.934
		6.766	27	–	1.637.599	3.567	7.260.260	3.364	14.809.024
Quellensteuern	*1*	1.353.511	820	28.972	1.191	644.858	–	–	–
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(961.044.302)	–	(5.664.222)	(9.221.023)	(115.468.447)	(24.133.828)	(1.611.554)	(312.428.965)

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.
** Der Commodities wurde am 9. Februar 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	Emerging Market Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Market Debt - Local Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Market Debt Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Markets Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Markets Select Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Euro Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Euro Bond Absolute Return Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR
Erträge									
Zinserträge	*1*	161.758.842	94.893.060	38.711.817	1.731.498	113.992	44.263	291.490	1.478.485
Dividendenerträge	*1*	–	–	–	–	6.665.213	1.781.971	–	–
Erträge aus der Wertpapierleihe	*18*	4.832	–	225	–	3.729	7.254	–	1.599
Sonstige Erträge		1.169	1.378.016	223.635	5.772	–	–	15.109	774
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	(907.566.216)	(362.048.632)	(194.294.151)	(10.289.442)	(104.550.163)	(31.139.498)	(1.973.354)	(2.689.235)
		(745.801.373)	(265.777.556)	(155.358.474)	(8.552.172)	(97.767.229)	(29.306.010)	(1.666.755)	(1.208.377)
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	20.247.383	11.488.267	4.507.415	213.980	3.549.106	848.534	35.202	129.504
Vertriebsgebühren	*6*	283.501	488.229	28.973	–	633.038	–	–	–
Verwaltungsgebühren	*6*	1.498.184	993.867	507.693	94.007	269.047	65.031	47.375	75.304
Bereitstellungsprovision	*19*	404.319	234.390	88.155	5.838	37.131	13.636	1.393	7.513
Depotgebühren	*6*	182.518	994.955	215.807	11.978	158.696	57.652	11.642	11.642
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	132.993	81.447	32.932	2.138	14.844	4.995	503	2.696
Honorare	*9*	264.145	214.230	115.727	49.205	157.724	74.598	42.648	45.713
Honorare der Direktoren	*7*	6.008	5.708	4.408	6.013	6.008	6.013	4.290	4.289
Transaktionskosten	*9*	283.413	821.821	321.071	67.397	821.150	220.689	12.629	30.251
Prüfungshonorare	*8*	–	–	5.551	10.090	1.352	7.475	5.419	4.796
Umsatzsteuerentlastung		(12.788)	(7.942)	(3.297)	(250)	(1.488)	(470)	(48)	(260)
Sonstige Aufwendungen	*9*	21.140	7.379	12.886	28.191	25.030	12.433	7.283	17.286
Kostenverzicht	*6*	–	(73.477)	–	(179.530)	–	–	(97.305)	(75.384)
Aufwendungen insgesamt		23.310.816	15.248.874	5.837.321	309.057	5.671.638	1.310.586	71.031	253.350
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		5.356	21.844	14.000	147	1.954	235	186	933
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	40.376.295	27.734.955	6.413.111	–	2.683	391	228.600	273.051
		40.381.651	27.756.799	6.427.111	147	4.637	626	228.786	273.984
Quellensteuern	*1*	194	2.910.677	619.394	35.333	741.654	254.565	22	339
Kapitalertragsteuer	*1*	–	(1.700.716)	(253.248)	(892)	288.157	59.418	–	–
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(809.494.034)	(309.993.190)	(167.989.052)	(8.895.817)	(104.473.315)	(30.931.205)	(1.966.594)	(1.736.050)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	European High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	European Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Event Driven Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022* US$	Global Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Diversified Income FMP – 2024 Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Equity Megatrends Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Flexible Credit Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global SDG Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$
Erträge									
Zinserträge	*1*	1.579.480	285	46.006	3.672.397	9.413.111	6.923	31.152.028	9.427.806
Dividendenerträge	*1*	–	2.232.834	–	–	–	871.691	27.852	–
Erträge aus der Wertpapierleihe	*18*	977	–	–	1	–	–	–	64
Sonstige Erträge		–	–	–	64	–	41.273	575.391	146.217
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	(2.325.679)	(34.675.503)	1.508.010	(29.797.838)	(18.259.895)	(11.756.473)	(153.936.569)	(28.263.433)
		(745.222)	(32.442.384)	1.554.016	(26.125.376)	(8.846.784)	(10.836.586)	(122.181.298)	(18.689.346)
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	123.290	703.244	45.155	10.726	1.127.870	1.156.284	2.181.890	538.649
Vertriebsgebühren	*6*	2.676	246	–	6.835	–	231.163	52.452	9.621
Verwaltungsgebühren	*6*	98.701	92.580	6.126	158.041	119.720	146.949	296.237	170.523
Bereitstellungsprovision	*19*	4.866	18.552	–	19.323	29.244	10.953	81.408	17.656
Depotgebühren	*6*	12.142	16.501	1.088	11.978	12.000	11.978	19.553	11.978
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	1.766	7.448	180	7.385	10.580	3.997	27.943	8.288
Honorare	*9*	54.516	51.880	10.026	65.013	68.920	13.585	66.596	77.026
Honorare der Direktoren	*7*	4.290	4.290	756	6.008	4.413	6.013	5.108	4.608
Erfolgsabhängige Gebühr	*6*	–	–	89.185	–	–	–	–	–
Transaktionskosten	*9*	20.917	272.168	1.300	60.787	5.996	52.011	54.664	58.010
Gründungsaufwendungen	*9*	–	–	41.146	–	–	–	–	–
Prüfungshonorare	*8*	4.766	4.102	9.261	6.103	5.474	5.975	5.755	6.692
Umsatzsteuerentlastung		(164)	(833)	–	(717)	(1.304)	(471)	(3.680)	(355)
Sonstige Aufwendungen	*9*	7.237	14.409	1.019	6.134	7.137	16.621	8.902	9.459
Kostenverzicht	*6*	(133.519)	(2.297)	(18.805)	(15.740)	–	–	–	(170.483)
Verzicht auf Gebühren	*6*	–	–	–	–	–	–	(3.232)	–
Aufwendungen insgesamt		201.484	1.182.290	186.437	341.876	1.390.050	1.655.058	2.793.596	741.672
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		–	1.299	4	1.712	–	357	9.004	5
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	42.280	102.238	–	2.670	6.122.730	–	17.376	199.127
		42.280	103.537	4	4.382	6.122.730	357	26.380	199.132
Quellensteuern	*1*	–	259.294	–	11.787	–	132.826	404.810	–
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(988.986)	(33.987.505)	1.367.575	(26.483.421)	(16.359.564)	(12.624.827)	(125.406.084)	(19.630.150)

* Der Event Driven wurde am 26. Oktober 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	Global High Yield Sustainable Action Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Investment Grade Credit Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Opportunistic Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Sustainable Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	InnovAsia 5G Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$
Erträge									
Zinserträge	*1*	795.609	2.806.792	2.954.283	9.224	24.531	7.219	148.199.441	9.677
Dividendenerträge	*1*	–	–	146.100	1.602.477	1.528.140	1.514.896	1.708.574	298.196
Erträge aus der Wertpapierleihe	*18*	–	–	142	–	–	410	369.752	–
Sonstige Erträge		–	–	6	–	–	485	1.121.365	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	(2.685.869)	(16.760.362)	(13.983.992)	(16.363.551)	(68.012.895)	(5.399.900)	(500.609.800)	(11.968.585)
		(1.890.260)	(13.953.570)	(10.883.461)	(14.751.850)	(66.460.224)	(3.876.890)	(349.210.668)	(11.660.712)
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	81.903	45.058	169.512	321.261	776.253	117.742	22.808.364	190.730
Vertriebsgebühren	*6*	–	–	2.561	24.343	63.178	4.586	2.403.333	261
Verwaltungsgebühren	*6*	66.803	75.396	153.587	78.512	112.556	67.551	1.707.662	58.185
Bereitstellungsprovision	*19*	2.185	1.339	12.291	7.270	28.977	7.706	368.659	3.217
Depotgebühren	*6*	12.000	14.000	11.978	12.000	12.000	12.978	32.781	12.993
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	782	2.734	4.127	2.329	9.493	2.335	124.075	506
Honorare	*9*	36.984	68.532	51.748	63.979	54.659	100.404	281.572	105.017
Honorare der Direktoren	*7*	4.408	4.230	4.608	4.408	4.408	4.408	4.413	5.344
Transaktionskosten	*9*	4.102	1.543	70.999	127.175	126.209	186.029	280.642	203.216
Prüfungshonorare	*8*	6.414	15.088	8.086	7.164	6.110	6.053	688	13.494
Umsatzsteuerentlastung		(66)	(542)	(407)	(245)	(1.256)	(208)	(15.511)	(131)
Sonstige Aufwendungen	*9*	7.671	4.816	28.964	10.704	614	6.957	10.586	7.975
Kostenverzicht	*6*	(108.883)	(73.986)	(136.859)	(89.942)	–	(134.803)	–	(243.487)
Verzicht auf Gebühren	*6*	–	–	(1.023)	–	–	–	(200.972)	–
Aufwendungen insgesamt		114.303	158.208	380.172	568.958	1.193.201	381.738	27.806.292	357.320
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		–	106	1.878	295	496	274	13.752	47
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	548.922	–	242.312	250.739	–	–	89.100.366	–
		548.922	106	244.190	251.034	496	274	89.114.118	47
Quellensteuern	*1*	–	2.143	6.303	335.421	377.588	287.847	193.502	47.134
Kapitalertragsteuer	*1*	–	–	–	–	–	–	–	4.532
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(2.553.485)	(14.114.027)	(11.514.126)	(15.907.263)	(68.031.509)	(4.546.749)	(466.324.580)	(12.069.745)

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

		Japan Equity Engagement	Macro Opportunities FX	Multi-Asset Erträge	Next Generation Mobility	Next Generation Space Economy	Responsible Asian Debt - Hard Currency	Short Duration Emerging Market Debt	Short Duration High Yield SDG Engagement
		Geschäftsjahr zum	Geschäftsjahr zum	Geschäftsjahr zum	Geschäftsjahr zum	Berichtszeitraum zum	Geschäftsjahr zum	Geschäftsjahr zum	Geschäftsjahr zum
	Anm.	31. Dezember 2022	31. Dezember 2022	31. Dezember 2022	31. Dezember 2022	31. Dezember 2022*	31. Dezember 2022	31. Dezember 2022	31. Dezember 2022
		JPY	EUR	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Erträge									
Zinserträge	1	–	320.985	405.092	132.714	6.059	606.076	243.380.880	32.092.463
Dividendenerträge	1	414.616.230	–	311.350	1.633.835	67.962	–	–	124.934
Erträge aus der Wertpapierleihe	18	–	–	–	–	–	–	11.742	19.067
Sonstige Erträge		–	–	2.621	–	–	–	–	36.380
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	11	(1.741.078.724)	(1.971.787)	(3.111.883)	(57.817.347)	(432.375)	(1.891.100)	(1.101.068.370)	(89.765.536)
		(1.326.462.494)	(1.650.802)	(2.392.820)	(56.050.798)	(358.354)	(1.285.024)	(857.675.748)	(57.492.692)
Aufwendungen									
Managementgebühr	6	100.811.266	168.525	191.307	2.355.835	38.201	98.138	31.402.765	3.565.600
Vertriebsgebühren	6	–	137	43.482	372.424	5.251	5.192	843.022	79.027
Verwaltungsgebühren	6	10.583.025	66.743	130.760	174.933	18.121	63.440	2.510.377	346.178
Bereitstellungsprovision	19	1.161.813	5.229	2.735	24.197	116	1.809	823.258	78.800
Depotgebühren	6	2.339.804	11.661	11.978	12.000	8.033	11.978	419.115	13.978
Gebühren der Verwahrstelle	6	927.073	1.776	933	8.609	109	715	283.218	27.328
Honorare	9	5.788.301	44.584	58.885	59.724	44.930	55.583	385.610	96.916
Honorare der Direktoren	7	645.304	4.290	4.408	6.008	3.292	4.413	4.408	6.008
Transaktionskosten	9	25.289.140	47.420	72.084	71.537	16.665	7.709	142.903	67.382
Gründungsaufwendungen	9	–	–	–	–	33.380	–	–	–
Prüfungshonorare	8	564.361	6.418	5.536	8.876	9.810	7.945	1.852	–
Umsatzsteuerentlastung		(109.192)	(221)	(95)	(808)	–	(55)	(27.820)	(2.514)
Sonstige Aufwendungen	9	1.448.080	10.186	6.942	19.744	408	10.209	2.844	14.088
Kostenverzicht	6	–	(110.430)	(244.304)	–	(91.761)	(137.097)	–	–
Verzicht auf Gebühren	6	–	–	–	–	–	–	–	(14.829)
Aufwendungen insgesamt		149.448.975	256.318	284.651	3.113.079	86.555	129.979	36.791.552	4.277.962
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		2.090.931	386	413	–	–	179	54.957	–
Gezahlte Ausschüttungen	1	–	1.645	12.262	–	–	348.676	62.694.586	2.796.817
		2.090.931	2.031	12.675	–	–	348.855	62.749.543	2.796.817
Quellensteuern	1	62.192.435	–	71.831	317.930	8.953	–	–	–
Kapitalertragsteuer	1	–	–	(490)	–	–	–	–	–
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(1.540.194.835)	(1.909.151)	(2.761.487)	(59.481.807)	(453.862)	(1.763.858)	(957.216.843)	(64.567.471)

*Der Next Generation Space Economy wurde am 10. Mai 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	Strategic Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Sustainable Asia High Yield Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Sustainable Emerging Market Corporate Debt Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022* US$	Ultra Short Term Euro Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Uncorrelated Strategies Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Uncorrelated Trading Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022** US$	US Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$
Erträge									
Zinserträge	*1*	49.594.262	2.538.288	5.944.374	5.638.541	21.554.078	11.033.398	1.912.636	15.809
Dividendenerträge	*1*	60.777	–	–	–	–	–	38	242.296
Erträge aus der Wertpapierleihe	*18*	21.952	–	151	–	36.550	–	–	2.477
Sonstige Erträge		179.045	–	64	–	3.743	1.107.014	273	756
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	(245.259.988)	(18.519.194)	(28.879.284)	(21.709.100)	(78.146.103)	77.671.657	4.170.627	(5.354.167)
		(195.403.952)	(15.980.906)	(22.934.695)	(16.070.559)	(56.551.732)	89.812.069	6.083.574	(5.092.829)
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	8.737.824	198.639	836.649	386.207	1.556.522	18.385.164	3.988.226	148.193
Vertriebsgebühren	*6*	1.030.707	–	27.424	–	211	190.442	–	60
Verwaltungsgebühren	*6*	1.038.690	61.962	149.105	67.923	500.760	2.874.345	303.853	41.720
Bereitstellungsprovision	*19*	186.188	458	16.486	2.145	148.736	365.564	9.457	3.100
Depotgebühren	*6*	38.581	12.316	12.978	11.419	87.036	320.288	25.474	12.578
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	67.232	1.352	5.695	3.564	52.628	274.758	18.195	1.056
Honorare	*9*	157.565	114.191	136.208	81.203	96.997	571.729	70.868	44.023
Honorare der Direktoren	*7*	5.708	5.536	6.008	4.693	4.289	4.413	3.292	4.408
Erfolgsabhängige Gebühr	*6*	–	–	–	–	–	75.878.127	1.351	–
Transaktionskosten	*9*	278.648	23.533	35.949	12.589	151.594	21.937.585	2.244.454	13.626
Gründungsaufwendungen	*9*	–	–	–	34.116	–	–	105.495	–
Prüfungshonorare	*8*	12.275	4.007	5.338	9.712	6.235	6.380	9.787	2.448
Umsatzsteuerentlastung		(6.168)	(331)	(602)	(659)	(5.258)	(15.957)	–	(63)
Sonstige Aufwendungen	*9*	428	6.090	7.507	8.245	6.891	5.579.817	370.398	8.544
Kostenverzicht	*6*	–	(160.143)	(165.230)	(53.094)	–	–	–	(81.644)
Verzicht auf Gebühren	*6*	(7.051)	–	–	–	–	–	–	–
Aufwendungen insgesamt		11.540.627	267.610	1.073.515	568.063	2.606.641	126.372.655	7.150.850	198.049
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		238	45	7.376	1.319	–	174.016	20.681	1.209
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	8.334.033	270.363	286.367	–	22.323	–	–	–
		8.334.271	270.408	293.743	1.319	22.323	174.016	20.681	1.209
Quellensteuern	*1*	487.232	12.927	28	108.561	14.929	4.333.351	134.918	66.696
Kapitalertragsteuer	*1*	(63.251)	–	–	–	–	–	–	–
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(215.702.831)	(16.531.851)	(24.301.981)	(16.748.502)	(59.195.625)	(41.067.953)	(1.222.875)	(5.358.783)

* Der Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency wurde am 19. Januar 2022 aufgelegt.
** Der Uncorrelated Tradin Fund wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Gewinn- und Verlustrechnungen (Fortsetzung)

	Anm.	US Equity Index PutWrite Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Large Cap Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Long Short Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Multi Cap Opportunities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Small Cap Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Small Cap Intrinsic Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Fonds insgesamt* Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$
Erträge									
Zinserträge	*1*	4.282.751	780.830	960.562	28.718	175.899	161.231	172.395	991.009.766
Dividendenerträge	*1*	–	22.063.565	2.999.980	7.826.211	27.655.707	5.705.571	1.283.944	109.148.302
Erträge aus der Wertpapierleihe	*18*	–	–	67.468	–	–	–	–	611.992
Sonstige Erträge		–	–	99.423	–	–	9.340	–	4.987.703
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	*11*	(87.672.202)	(27.395.274)	(36.844.968)	(150.019.669)	(301.673.396)	(155.375.348)	(39.191.641)	(6.379.690.095)
		(83.389.451)	(4.550.879)	(32.717.535)	(142.164.740)	(273.841.790)	(149.499.206)	(37.735.302)	(5.273.932.332)
Aufwendungen									
Managementgebühr	*6*	2.579.752	4.595.988	3.334.050	7.378.299	11.237.220	6.754.678	1.555.235	220.981.106
Vertriebsgebühren	*6*	13.247	119.897	41.179	909.109	2.002.809	729.500	5.331	11.861.633
Verwaltungsgebühren	*6*	365.241	473.775	193.545	514.127	1.401.818	462.685	133.735	21.323.731
Bereitstellungsprovision	*19*	85.448	21.713	31.545	92.632	122.751	78.869	25.463	3.978.990
Depotgebühren	*6*	11.978	14.473	12.000	12.678	13.121	13.116	12.578	3.500.933
Gebühren der Verwahrstelle	*6*	30.355	31.007	12.921	31.614	41.239	30.452	9.069	1.640.283
Honorare	*9*	102.534	100.402	65.729	138.031	188.463	132.690	55.026	5.741.188
Honorare der Direktoren	*7*	4.408	5.636	4.408	4.413	5.408	6.008	5.608	259.448
Erfolgsabhängige Gebühr	*6*	–	–	–	–	–	–	–	75.968.663
Transaktionskosten	*9*	129.938	570.124	172.070	282.497	502.855	283.573	89.127	36.341.706
Gründungsaufwendungen	*9*	–	–	–	–	–	–	–	248.619
Prüfungshonorare	*8*	4.727	5.832	5.893	4.670	2.286	3.785	7.040	321.771
Umsatzsteuerentlastung		(2.475)	(4.523)	(1.273)	(3.192)	(4.326)	(2.706)	(763)	(157.381)
Sonstige Aufwendungen	*9*	9.112	11.137	84.198	10.161	12.037	12.304	14.150	6.586.467
Kostenverzicht	*6*	–	–	–	–	–	–	–	(2.876.095)
Verzicht auf Gebühren	*6*	–	–	–	–	–	–	–	(227.107)
Aufwendungen insgesamt		3.334.265	5.945.461	3.956.265	9.375.039	15.525.681	8.504.954	1.911.599	385.493.955
Finanzierungskosten									
Zinsaufwendungen		–	69.033	2	3.133	821	2.396	–	436.593
Gezahlte Ausschüttungen	*1*	5.382.746	–	–	13.581	7.297.490	–	–	282.296.687
		5.382.746	69.033	2	16.714	7.298.311	2.396	–	282.733.280
Quellensteuern	*1*	–	5.986.352	764.464	2.248.107	7.595.368	1.678.872	334.116	33.280.542
Kapitalertragsteuer	*1*	–	–	–	–	–	–	–	(1.666.490)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(92.106.462)	(16.551.725)	(37.438.266)	(153.804.600)	(304.261.150)	(159.685.428)	(39.981.017)	(5.973.773.619)

Alle Erträge und Aufwendungen ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit – mit Ausnahme des Absolute Return Multi Strategy, der am 20. Dezember 2021 aufgelöst wurde. Außer den in der konsolidierten Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne und Verluste im Geschäftsjahr.

* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens

	Anm.	5G Connectivity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Absolute Return Multi Strategy Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023* US$	China A-Share Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 CNY	China Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 CNY	China Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Climate Innovation Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023** US$	CLO Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Commodities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		993.010.193	–	16.241.758	453.043.579	317.413.676	–	138.037.464	85.997.429
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		330.847.620	–	(2.027.926)	37.288.963	(63.785.405)	(107.445)	21.699.437	(6.936.475)
Zeichnungen	*5*	94.038.379	–	–	802.851	13.990.560	3.030.000	85.952.524	94.882.598
Rücknahmen	*5*	(374.369.249)	–	–	(32.289.285)	(89.392.544)	–	(60.043.120)	(20.296.993)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		1.043.526.943	–	14.213.832	458.846.108	178.226.287	2.922.555	185.646.305	153.646.559

	Anm.	Corporate Hybrid Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	Developed Market FMP – 2027 Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023*** US$	Emerging Market Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Market Debt - Local Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Market Debt Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Markets Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Emerging Markets Select Equity Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023**** US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		1.782.154.808	–	2.491.704.928	1.386.264.443	470.181.480	54.274.381	191.807.755	93.762.122
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		124.965.012	5.457.030	297.691.613	141.712.762	54.178.232	3.538.481	9.563.366	2.762.893
Zeichnungen	*5*	657.882.054	138.602.529	1.047.274.763	231.862.147	124.905.703	53.127.987	87.850.549	901.671
Rücknahmen	*5*	(695.185.411)	(6.601.740)	(1.186.852.649)	(473.971.705)	(122.477.608)	(45.873.300)	(198.534.169)	(97.426.686)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		1.869.816.463	137.457.819	2.649.818.655	1.285.867.647	526.787.807	65.067.549	90.687.501	–

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.
** Der Climate Innovation wurde am 1. August 2023 aufgelegt.
*** Der Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 wurde am 31. Juli 2023 aufgelegt.
**** Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	Anm.	Euro Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	Euro Bond Absolute Return Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	European High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	European Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	Event Driven Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Diversified Income FMP – 2024 Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Equity Megatrends Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		9.294.742	48.527.876	32.454.528	175.854.230	41.446.672	134.811.296	160.396.086	79.344.365
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		751.195	2.896.736	22.874.571	29.936.586	8.295.425	7.287.720	5.135.348	19.600.362
Zeichnungen	*5*	527.157	691.146	373.361.838	27.413.412	105.767.010	12.172.804	36.761	73.983.326
Rücknahmen	*5*	–	(18.088.931)	(20.274.620)	(61.106.677)	(29.096.959)	(45.529.020)	(9.368.542)	(28.445.197)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		10.573.094	34.026.827	408.416.317	172.097.551	126.412.148	108.742.800	156.199.653	144.482.856

	Anm.	Global Flexible Credit Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global SDG Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global High Yield Sustainable Action Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* US$	Global Investment Grade Credit Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Opportunistic Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Global Sustainable Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		394.526.329	336.953.378	15.047.068	85.908.642	76.105.443	39.022.420	131.578.199	48.024.441
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		55.380.593	54.116.542	343.290	7.956.491	4.158.964	672.388	31.127.307	7.735.835
Zeichnungen	*5*	52.117.731	246.709.213	–	484.692	4.389.912	2.913.943	18.111.427	14.627.475
Rücknahmen	*5*	(111.411.672)	(79.615.228)	(15.390.358)	(7.572.000)	(19.244.556)	(22.148.738)	(26.243.638)	(14.921.857)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		390.612.981	558.163.905	–	86.777.825	65.409.763	20.460.013	154.573.295	55.465.894

* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	Anm.	High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	InnovAsia 5G Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Japan Equity Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 JPY	Macro Opportunities FX Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR	Multi-Asset Income Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* US$	Next Generation Mobility Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Next Generation Space Economy Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Responsible Asian Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		2.298.751.712	14.748.993	20.542.667.585	31.510.156	11.366.115	148.004.677	8.490.862	21.626.209
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		144.477.255	5.241.350	4.836.098.350	(763.083)	236.464	40.203.709	3.269.553	2.750.828
Zeichnungen	*5*	561.207.918	6.477.592	7.483.761.065	8.167.159	24.302	24.503.776	8.813.182	50.126.106
Rücknahmen	*5*	(752.626.166)	(2.697.815)	(16.684.998.285)	(36.032.426)	(11.626.881)	(48.356.097)	(829.667)	(10.561.279)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		2.251.810.719	23.770.120	16.177.528.715	2.881.806	–	164.356.065	19.743.930	63.941.864

	Anm.	Short Duration Emerging Market Debt Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Short Duration High Yield SDG Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Strategic Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Sustainable Asia High Yield Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Sustainable Emerging Market Corporate Debt Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Tactical Macro Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023** US$	Ultra Short Term Euro Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 EUR
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		5.124.661.750	556.373.679	1.322.805.855	31.922.271	98.244.308	158.420.594	–	821.390.067
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		276.312.077	38.090.157	88.223.360	541.427	8.656.916	41.175.536	716.419	58.088.664
Zeichnungen	*5*	913.802.369	477.921.105	1.129.764.227	21.287	5.980.010	350.525.367	26.445.889	466.117.965
Rücknahmen	*5*	(2.360.006.629)	(327.950.494)	(521.189.861)	(3.920.034)	(15.092.097)	(104.229.227)	–	(352.724.398)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		3.954.769.567	744.434.447	2.019.603.581	28.564.951	97.789.137	445.892.270	27.162.308	992.872.298

* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.
** Der Tactical Macro wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	Anm.	Uncorrelated Strategies Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Uncorrelated Trading Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023* US$	US Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Equity Index PutWrite Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Large Cap Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Long Short Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Multi Cap Opportunities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		3.130.486.982	711.942.710	31.464.829	680.456.738	1.767.954.359	221.529.901	441.315.950	648.025.795
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(148.818.353)	(14.165.514)	9.066.626	109.770.608	(54.391.287)	27.000.196	67.319.121	42.410.727
Zeichnungen	5	901.511.546	11.358.695	10.264.274	214.235.309	791.197.422	53.782.532	97.292.578	93.896.935
Rücknahmen	5	(2.256.478.754)	(709.135.891)	(1.593.580)	(275.364.655)	(565.570.116)	(106.842.338)	(205.435.614)	(251.223.472)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		1.626.701.421	–	49.202.149	729.098.000	1.939.190.378	195.470.291	400.492.035	533.109.985

	Anm.	US Small Cap Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	US Small Cap Intrinsic Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$	Fonds insgesamt* Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		592.378.667	194.041.040	29.114.382.221
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		83.834.921	33.909.433	2.086.710.127
Wechselkursbewegung	*15*	–	–	111.001.114
Zeichnungen	*5*	148.231.776	127.106.174	10.224.468.692
Rücknahmen	*5*	(190.593.595)	(33.488.030)	(13.212.229.398)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		633.851.769	321.568.617	28.324.332.756

* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.
** Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	Anm.	5G Connectivity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Absolute Return Multi Strategy Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022* US$	China A-Share Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 CNY	China Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 CNY	China Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	CLO Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Commodities Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022** US$	Corporate Hybrid Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		2.395.521.641	–	24.427.958	580.753.658	529.341.191	149.839.432	–	2.458.411.975
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(961.044.302)	–	(5.664.222)	(9.221.023)	(115.468.447)	(24.133.828)	(1.611.554)	(312.428.965)
Zeichnungen	*5*	197.172.123	–	133.524	47.011.277	200.374	30.409.011	104.395.961	845.732.739
Rücknahmen	*5*	(638.639.269)	–	(2.655.502)	(165.500.333)	(96.659.442)	(18.077.151)	(16.786.978)	(1.209.560.941)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		993.010.193	–	16.241.758	453.043.579	317.413.676	138.037.464	85.997.429	1.782.154.808

	Anm.	Emerging Market Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Market Debt - Local Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Market Debt Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Markets Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Emerging Markets Select Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Euro Bond Geschäftsjahr zum 31.Dezember 2022 EUR	Euro Bond Absolute Return Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		3.612.575.490	2.102.682.652	947.581.444	47.386.279	388.690.425	125.356.269	11.211.336	54.164.845
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(809.494.034)	(309.993.190)	(167.989.052)	(8.895.817)	(104.473.315)	(30.931.205)	(1.966.594)	(1.736.050)
Zeichnungen	*5*	1.181.314.266	200.530.321	109.802.796	25.051.224	75.505.768	2.830.898	50.000	21.594.998
Rücknahmen	*5*	(1.492.690.794)	(606.955.340)	(419.213.708)	(9.267.305)	(167.915.123)	(3.493.840)	–	(25.495.917)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		2.491.704.928	1.386.264.443	470.181.480	54.274.381	191.807.755	93.762.122	9.294.742	48.527.876

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.
** Der Commodities wurde am 9. Februar 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	Anm.	European High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	European Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Event Driven Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022* US$	Global Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Diversified Income FMP – 2024 Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Equity Megatrends Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Flexible Credit Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global SDG Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		38.865.311	113.886.075	–	180.397.378	233.747.409	83.153.849	705.212.784	39.627.349
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(988.986)	(33.987.505)	1.367.575	(26.483.421)	(16.359.564)	(12.624.827)	(125.406.084)	(19.630.150)
Zeichnungen	*5*	14.163.971	152.610.854	40.079.097	14.765.120	19.901	37.435.263	107.028.934	420.495.825
Rücknahmen	*5*	(19.585.768)	(56.655.194)	–	(33.867.781)	(57.011.660)	(28.619.920)	(292.309.305)	(103.539.646)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		32.454.528	175.854.230	41.446.672	134.811.296	160.396.086	79.344.365	394.526.329	336.953.378

	Anm.	Global High Yield Sustainable Action Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Investment Grade Credit Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Opportunistic Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Sustainable Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Global Sustainable Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	High Yield Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	InnovAsia 5G Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		17.600.553	98.810.202	94.244.831	50.887.571	203.986.580	20.888.250	3.203.355.473	26.794.987
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(2.553.485)	(14.114.027)	(11.514.126)	(15.907.263)	(68.031.509)	(4.546.749)	(466.324.580)	(12.069.745)
Zeichnungen	*5*	–	1.212.467	22.054.010	21.873.961	123.872.119	74.254.494	663.733.644	6.308.354
Rücknahmen	*5*	–	–	(28.679.272)	(17.831.849)	(128.248.991)	(42.571.554)	(1.102.012.825)	(6.284.603)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		15.047.068	85.908.642	76.105.443	39.022.420	131.578.199	48.024.441	2.298.751.712	14.748.993

* Der Event Driven wurde am 26. Oktober 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	Anm.	Japan Equity Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 JPY	Macro Opportunities FX Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Multi-Asset Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Next Generation Mobility Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Next Generation Space Economy Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022* US$	Responsible Asian Debt - Hard Currency Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Short Duration Emerging Market Debt Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Short Duration High Yield SDG Engagement Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		12.105.937.644	44.609.891	22.705.351	220.483.316	–	14.429.520	6.934.454.095	644.439.910
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(1.540.194.835)	(1.909.151)	(2.761.487)	(59.481.807)	(453.862)	(1.763.858)	(957.216.843)	(64.567.471)
Zeichnungen	5	16.188.114.198	20.283.746	1.394.430	39.564.733	8.972.341	18.601.061	1.374.964.811	191.676.597
Rücknahmen	5	(6.211.189.422)	(31.474.330)	(9.972.179)	(52.561.565)	(27.617)	(9.640.514)	(2.227.540.313)	(215.175.357)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		20.542.667.585	31.510.156	11.366.115	148.004.677	8.490.862	21.626.209	5.124.661.750	556.373.679

	Anm.	Strategic Income Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Sustainable Asia High Yield Geschäftsjahr zum 31.Dezember 2022 US$	Sustainable Emerging Market Corporate Debt Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022** US$	Ultra Short Term Euro Bond Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 EUR	Uncorrelated Strategies Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	Uncorrelated Trading Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022*** US$	US Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		1.444.921.523	24.721.277	145.057.425	–	1.160.670.538	2.578.359.212	–	8.931.605
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(215.702.831)	(16.531.851)	(24.301.981)	(16.748.502)	(59.195.625)	(41.067.953)	(1.222.875)	(5.358.783)
Zeichnungen	5	469.594.244	92.794.221	20.402.615	189.296.638	683.149.224	1.666.039.977	735.655.808	29.146.487
Rücknahmen	5	(376.007.081)	(69.061.376)	(42.913.751)	(14.127.542)	(963.234.070)	(1.072.844.254)	(22.490.223)	(1.254.480)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		1.322.805.855	31.922.271	98.244.308	158.420.594	821.390.067	3.130.486.982	711.942.710	31.464.829

* Der Next Generation Space Economy wurde am 10. Mai 2022 aufgelegt.
** Der Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency wurde am 19. Januar 2022 aufgelegt.
** Der Uncorrelated Trading Fund wurde am 14. Juni 2022 aufgelegt.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

	Anm.	US Equity Index PutWrite Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Large Cap Value Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Long Short Equity Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Multi Cap Opportunities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Real Estate Securities Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Small Cap Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 US$	US Small Cap Intrinsic Value Geschäftsjahr zum 31.Dezember 2022 US$	Fonds insgesamt* Geschäftsjahr zum 31.Dezember 2022 US$
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres		475.077.135	2.045.700	474.020.776	781.225.671	1.022.296.968	822.142.195	153.622.426	35.433.928.751
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallender Gewinn/(Verlust) aus der Geschäftstätigkeit		(92.106.462)	(16.551.725)	(37.438.266)	(153.804.600)	(304.261.150)	(159.685.428)	(39.981.017)	(5.973.773.619)
Wechselkursbewegung	*15*	–	–	–	–	–	–	–	(304.151.197)
Zeichnungen	*5*	447.110.889	1.918.802.436	104.119.789	199.217.907	413.904.299	359.181.498	105.049.569	13.810.902.186
Rücknahmen	*5*	(149.624.824)	(136.342.052)	(319.172.398)	(385.323.028)	(483.914.322)	(429.259.598)	(24.649.938)	(13.852.523.900)
Auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallendes Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres		680.456.738	1.767.954.359	221.529.901	441.315.950	648.025.795	592.378.667	194.041.040	29.114.382.221

* Der konsolidierte Jahresabschluss wurde um Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios bereinigt. Details zu Überkreuzinvestitionen zwischen Portfolios sind Anmerkung 10 der Anmerkungen zum geprüften Jahresabschluss zu entnehmen.

Die Anmerkungen im Anhang sind wesentlicher Bestandteil des Jahresabschlusses.

Aufstellungen der wesentlichen Käufe und Verkäufe (ungeprüft)

In Einklang mit den EG-Richtlinien über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011") (in ihrer geltenden Fassung) wird eine Aufstellung über die Entwicklung der Zusammensetzung des Wertpapierbestands im Berichtszeitraum vorgelegt, um sicherzustellen, dass die Anteilinhaber Veränderungen in den vom Portfolio gehaltenen Anlagen identifizieren können. Die folgenden Aufstellungen geben die gesamten Käufe und Verkäufe von Wertpapieren, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe und Verkäufe im Berichtszeitraum übersteigen, wieder. Es werden mindestens die 20 größten Käufe und Verkäufe aufgeführt, falls zutreffend.

5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
252.400	Lasertec Corp	41.039.953
1.776.000	Maxscend Microelectronics Co Ltd Class A	36.203.846
695.046	STMicroelectronics NV	32.825.887
114.599	NVIDIA Corp	32.669.777
451.000	Alchip Technologies Ltd	32.161.673
239.816	Amazon.com Inc	31.861.122
204.200	Palo Alto Networks Inc	31.637.442
168.347	Workday Inc Class A	30.131.723
120.693	Meta Platforms Inc Class A	30.108.063
208.900	Disco Corp	29.442.821
109.792	Super Micro Computer Inc	27.826.779
186.258	Arista Networks Inc	27.797.553
710.704	Infineon Technologies AG	27.662.794
151.655	Analog Devices Inc	27.607.231
1.472.900	Renesas Electronics Corp	26.264.153
37.855	Broadcom Inc	26.032.267
38.977	ASML Holding NV	25.213.655
124.866	Salesforce Inc	24.237.515
7.331.900	Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A	23.637.495
49.700	Keyence Corp	23.075.833
350.877	Shopify Inc Class A	22.410.723
907.651	Deutsche Telekom AG	21.385.332
37.537	Lam Research Corp	21.216.240
7.796	Booking Holdings Inc	20.564.460
4.398.000	Quanta Computer Inc	20.413.553
166.666	QUALCOMM Inc	20.096.909
104.953	Atlassian Corp Class A	19.802.536
8.492.000	Wistron Corp	19.294.932
65.699	Microsoft Corp	19.207.496
231.466	SK Hynix Inc	19.189.521
235.723	ON Semiconductor Corp	18.677.491
754.057	Kanzhun Ltd ADR	18.289.235
465.200	TDK Corp	18.106.266
482.625	Pure Storage Inc Class A	16.975.996
1.089.000	Novatek Microelectronics Corp	16.642.314
344.468	Match Group Inc	15.935.325
3.426.000	Unimicron Technology Corp	15.763.476
149.364	BE Semiconductor Industries NV	15.621.984

5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
533.506	Juniper Networks Inc	15.525.963
146.639	Qorvo Inc	15.313.693
136.620	Dexcom Inc	15.289.375
106.198	T-Mobile US Inc	15.144.838
60.947	Enphase Energy Inc	14.556.763
137.845	Oracle Corp	14.456.037

5G Connectivity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
909.700	Advantest Corp	57.929.909
290.975	Arista Networks Inc	50.600.720
282.300	Lasertec Corp	47.153.026
106.667	ASM International NV	42.388.612
96.414	HubSpot Inc	41.627.951
87.531	Monolithic Power Systems Inc	40.117.788
981.361	Marvell Technology Inc	39.876.155
366.169	Advanced Micro Devices Inc	39.820.464
227.921	Keysight Technologies Inc	35.316.088
7.568.359	Nokia OYJ ADR	34.469.816
8.492.000	Wistron Corp	33.826.316
695.046	STMicroelectronics NV	32.557.807
175.057	Analog Devices Inc	31.097.975
853.000	StarPower Semiconductor Ltd Class A	30.379.701
5.987.000	Unimicron Technology Corp	29.914.900
4.398.000	Quanta Computer Inc	29.154.765
1.078.500	SG Micro Corp Class A	28.005.693
137.100	Disco Corp	27.228.511
733.231	Cellnex Telecom SA	26.979.786
838.109	Taiyo Yuden Co Ltd	26.570.433
131.706	Workday Inc Class A	25.357.015
126.304	Cadence Design Systems Inc	25.266.773
114.659	Palo Alto Networks Inc	25.217.444
1.776.000	Maxscend Microelectronics Co Ltd Class A	25.092.526
47.476	ServiceNow Inc	24.670.443
219.221	Crowdstrike Holdings Inc Class A	22.836.612
115.786	Enphase Energy Inc	22.773.523
374.138	Fortinet Inc	22.064.715
147.391	Snowflake Inc Class A	21.831.064
7.045	Booking Holdings Inc	20.045.781
53.633	Netflix Inc	19.772.989
411.301	Wolfspeed Inc	18.954.735
429.393	Ciena Corp	18.898.357
1.250.700	Sungrow Power Supply Co Ltd Class A	18.770.086
194.808	Alphabet Inc Class C	18.297.700
265.940	Datadog Inc Class A	18.217.697
126.028	T-Mobile US Inc	18.052.181
280.202	Shopify Inc Class A	16.006.922
246.575	Micron Technology Inc	15.861.037
147.906	Amazon.com Inc	15.625.592

China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten CNY
92.500	China Construction Bank Corp Class A	579.269
18.300	CITIC Securities Co Ltd Class A	400.611
16.800	TongFu Microelectronics Co Ltd Class A	363.512
30.000	China Life Insurance Co Ltd - H Shares	330.660
10.000	JCET Group Co Ltd Class A	314.489
1.100	BYD Co Ltd Class A	288.594
50.100	Shenzhen MTC Co Ltd Class A	270.562
2.600	Sungrow Power Supply Co Ltd Class A	263.112
2.700	Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A	260.656
3.700	Shenzhou International Group Holdings Ltd	254.715
78.000	China CITIC Bank Corp Ltd - H Shares	253.428
24.000	Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A	243.716
1.300	Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A	231.533
8.100	Shenzhen Sunlord Electronics Co Ltd Class A	230.548
1.307	Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China Class A	230.429
13.100	Yizumi Holdings Co Ltd Class A	230.005
3.700	Jiangsu Yoke Technology Co Ltd Class A	226.244
50.000	Nexteer Automotive Group Ltd	225.935
35.200	Baoshan Iron & Steel Co Ltd Class A	218.516
8.200	Shenzhen YUTO Packaging Technology Co Ltd Class A	212.383
16.800	China Galaxy Securities Co Ltd Class A	209.478
15.500	Weichai Power Co Ltd Class A	207.024
2.100	Tsingtao Brewery Co Ltd Class A	193.550
1.800	Milkyway Chemical Supply Chain Service Co Ltd Class A	190.602
3.232	Giantec Semiconductor Corp Class A	189.938
3.100	Eoptolink Technology Inc Ltd	182.572
28.000	AK Medical Holdings Ltd	179.997
1.800	Proya Cosmetics Co Ltd Class A	178.648
1.000	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	177.353
39.400	China United Network Communications Ltd Class A	176.891
650	Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A	176.112
26.000	Simcere Pharmaceutical Group Ltd	175.880
13.700	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd Class A	174.430
3.501	Piesat Information Technology Co Ltd Class A	174.399
20.700	China Railway Group Ltd Class A	173.988
6.100	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	170.286
11.900	First Tractor Co Ltd Class A	164.229
5.600	Chongqing Department Store Co Ltd Class A	162.269
6.100	Henan Shuanghui Investment & Development Co Ltd Class A	159.456
53.000	Sinotrans Ltd - H Shares	155.131
3.600	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	155.060
18.000	Yuexiu Property Co Ltd	151.867
5.900	Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A	151.489
781	Anji Microelectronics Technology Shanghai Co Ltd Class A	150.165

China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten CNY
12.000	SciClone Pharmaceuticals Holdings Ltd	148.114
1.759	Amlogic Shanghai Co Ltd Class A	147.210
1.800	Alibaba Group Holding Ltd	146.750
3.100	Shenzhen Sunnypol Optoelectronics Co Ltd Class A	141.369
37.000	Q Technology Group Co Ltd	140.511
9.500	China Jushi Co Ltd Class A	138.250
9.800	Dongfang Electric Corp Ltd Class A	137.743
2.346	Suzhou Recodeal Interconnect System Co Ltd Class A	134.491

China A-Share Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse CNY
32.020	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	802.577
6.800	Guangzhou Kingmed Diagnostics Group Co Ltd Class A	471.216
2.160	Contemporary Amperex Technology Co Ltd Class A	467.625
9.100	Ping An Insurance Group Co of China Ltd Class A	419.538
3.820	Will Semiconductor Co Ltd Shanghai Class A	396.960
28.300	Poly Developments & Holdings Group Co Ltd Class A	385.958
14.596	LONGi Green Energy Technology Co Ltd Class A	381.340
2.600	Wuliangye Yibin Co Ltd Class A	364.367
2.920	Meituan Class B	323.847
10.600	China Merchants Bank Co Ltd Class A	321.308
10.000	JCET Group Co Ltd Class A	317.286
1.100	Tencent Holdings Ltd	313.292
9.250	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co Ltd Class A	308.331
3.700	WuXi AppTec Co Ltd Class A	304.828
9.800	Tongwei Co Ltd Class A	288.659
4.200	Alibaba Group Holding Ltd	284.324
8.200	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	268.721
3.768	Montage Technology Co Ltd Class A	248.639
13.600	Ming Yang Smart Energy Group Ltd Class A	247.300
11.500	CITIC Securities Co Ltd Class A	241.019
3.300	Bethel Automotive Safety Systems Co Ltd Class A	233.404
4.433	Guangdong Haid Group Co Ltd Class A	219.085
1.307	Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China Class A	208.822
3.700	Jiangsu Yoke Technology Co Ltd Class A	203.404
26.700	Jiangsu Changshu Rural Commercial Bank Co Ltd Class A	187.582
15.354	China Jushi Co Ltd Class A	181.543
8.700	Sinoma Science & Technology Co Ltd Class A	179.186
13.000	Sany Heavy Industry Co Ltd Class A	178.385
41.910	TCL Technology Group Corp Class A	175.498
4.668	Hundsun Technologies Inc Class A	174.944
3.000	Wingtech Technology Co Ltd Class A	171.678
39.400	China United Network Communications Ltd Class A	170.996
3.700	TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd Class A	168.501
5.200	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd Class A	156.822
6.300	TongFu Microelectronics Co Ltd Class A	155.604
26.000	Simcere Pharmaceutical Group Ltd	152.793
13.700	China Merchants Shekou Industrial Zone Holdings Co Ltd Class A	144.586
7.700	WUS Printed Circuit Kunshan Co Ltd Class A	142.187
37.000	Q Technology Group Co Ltd	139.659
2.400	Yifeng Pharmacy Chain Co Ltd Class A	137.698
1.920	Hangzhou First Applied Material Co Ltd Class A	133.999
3.100	Shenzhen Sunnypol Optoelectronics Co Ltd Class A	133.822

China Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten CNY
55.000.000	China Government Bond, 2.67%, 25/05/2033	55.333.655
30.000.000	China Government Bond, 2.18%, 15/08/2026	29.791.250
20.000.000	Bank of China Ltd, 4.01%, 22/11/2029	20.334.720
20.000.000	China Southern Power Grid Co Ltd, 2.84%, 24/11/2025	19.919.840
20.000.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 2.60%, 06/11/2023	19.619.800
20.000.000	China Everbright Bank Co Ltd, 2.55%, 28/02/2023	19.556.420
20.000.000	Bank of Communications Co Ltd, 2.33%, 13/06/2024	19.553.540
20.000.000	China Citic Bank Corp, 2.49%, 22/05/2024	19.535.620
20.000.000	Agricultural Bank of China Ltd, 2.63%, 23/04/2024	19.496.260
10.000.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 4.15%, 21/01/2031	10.233.870
10.000.000	Guotai Junan Securities Co Ltd, 3.16%, 15/02/2026	10.083.300
10.000.000	China Resources Inc, 2.90%, 22/04/2025	10.078.090
10.000.000	China Three Gorges Renewables Group Co Ltd, 2.65%, 21/02/2025	10.039.170
10.000.000	Tianfeng Securities Co Ltd, 3.70%, 24/10/2023	10.018.630
10.000.000	China Minmetals Corp, 2.54%, 04/11/2025	9.987.380
10.000.000	Central Huijin Investment Ltd, 2.80%, 27/10/2026	9.985.900
10.000.000	Central Huijin Investment Ltd, 2.44%, 11/11/2025	9.863.350
9.500.000	China Government Bond, 2.39%, 15/11/2026	9.478.198
1.500.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026	9.369.430
1.000.000	TFI Overseas Investment Ltd, 6.50%, 05/06/2024	6.980.133
1.000.000	China Mengniu Dairy Co Ltd, 4.25%, 07/08/2023	6.867.066
1.000.000	China Hongqiao Group Ltd, 6.25%, 08/06/2024	6.790.530
1.000.000	Huarong Finance II Co Ltd, 5.50%, 16/01/2025	6.701.400
1.000.000	Blossom Joy Ltd, 3.10%, 29/12/2049	6.586.031
1.000.000	Studio City Finance Ltd, 6.00%, 15/07/2025	6.462.997
1.000.000	Tencent Holdings Ltd, 3.98%, 11/04/2029	6.340.104
1.000.000	Wynn Macau Ltd, 5.13%, 15/12/2029	5.588.909
6.000.000	Country Garden Holdings Co Ltd, 0.00%, 12/03/2026	4.800.000

China Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse CNY
30.000.000	Bank of China Ltd, 4.84%, 11/10/2028	30.394.110
30.000.000	Shanghai Pudong Development Bank Co Ltd, 2.44%, 15/02/2023	29.285.430
20.000.000	Bank of China Ltd, 4.01%, 22/11/2029	20.386.600
20.000.000	China Government Bond, 2.69%, 12/08/2026	20.231.400
20.000.000	Central Huijin Investment Ltd, 3.52%, 26/09/2024	20.152.160
20.000.000	GD Power Development Co Ltd, 3.33%, 06/07/2024	20.123.800
20.000.000	Shenzhen Metro Group Co Ltd, 3.25%, 12/07/2024	20.060.840
20.000.000	China Government Bond, 2.18%, 25/08/2025	20.021.460
20.000.000	China Citic Bank Corp, 0.00%, 22/09/2023	19.660.988
20.000.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 2.60%, 06/11/2023	19.640.020
20.000.000	China Everbright Bank Co Ltd, 2.55%, 28/02/2023	19.504.660
2.000.000	China Mengniu Dairy Co Ltd, 4.25%, 07/08/2023	13.734.202
10.000.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 4.15%, 21/01/2031	10.337.070
10.000.000	China Government Bond, 2.47%, 02/09/2024	10.050.170
10.000.000	Tianfeng Securities Co Ltd, 3.70%, 24/10/2023	10.044.860
9.000.000	China Government Bond, 2.67%, 25/05/2033	8.987.238
1.000.000	SF Holding Investment Ltd, 4.13%, 26/07/2023	6.878.225
1.000.000	China Construction Bank Corp, 1.00%, 04/08/2023	6.768.982
1.000.000	Kunlun Energy Co Ltd, 3.75%, 13/05/2025	6.734.093
1.000.000	Wynn Macau Ltd, 5.13%, 15/12/2029	5.744.886
2.000.000	Unigroup International Holdings Ltd, 6.00%, 28/04/2023	5.700.394
6.000.000	Country Garden Holdings Co Ltd, 0.00%, 12/03/2026	5.105.926
583.000	Shui On Development Holding Ltd, 5.75%, 12/11/2023	4.087.573

China Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
341.311	Trip.com Group Ltd ADR	12.868.669
1.766.919	TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd Class A	11.880.799
509.000	Meituan Class B	8.740.839
144.483	H World Group Ltd ADR	7.267.873
665.000	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A	6.637.212
660.000	Eve Energy Co Ltd Class A	6.211.463
264.071	Suzhou Maxwell Technologies Co Ltd Class A	6.187.334
219.921	Shenzhen Dynanonic Co Ltd Class A	6.156.976
330.090	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	4.747.874
400.000	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd Class A	3.925.868
4.014.000	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A	3.788.320
574.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	3.511.291
1.385.879	Satellite Chemical Co Ltd Class A	3.351.595
131.606	ZTO Express Cayman Inc ADR	3.108.582
495.922	Ninestar Corp Class A	3.102.146
499.898	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	2.239.958
335.500	Li Ning Co Ltd	1.916.674
437.000	Glodon Co Ltd, 22/07/2024 – Partycipatory Notes	1.806.240
174.500	Shenzhou International Group Holdings Ltd	1.758.390
39.500	Tencent Holdings Ltd	1.548.839
1.650.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	1.446.349
38.750	Trip.com Group Ltd	1.418.869
130.000	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	1.291.947
446.000	China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares	1.260.178
340.000	Zhongsheng Group Holdings Ltd	1.236.469
582.811	Sany Heavy Industry Co Ltd Class A	1.171.649

China Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
3.116.000	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co Ltd Class A	12.437.958
217.000	Tencent Holdings Ltd	10.038.167
741.000	Wanhua Chemical Group Co Ltd Class A	9.804.511
786.000	Alibaba Group Holding Ltd	9.447.102
3.533.007	Jiangsu Eastern Shenghong Co Ltd Class A	6.809.545
1.546.054	JL Mag Rare-Earth Co Ltd Class A	6.475.125
350.000	JD.com Inc Class A	6.244.163
144.483	H World Group Ltd ADR	5.976.985
2.208.648	TCL Zhonghuan Renewable Energy Technology Co Ltd Class A	5.874.644
1.169.000	Akeso Inc	5.628.706
351.873	Shenzhen Dynanonic Co Ltd Class A	5.330.260
1.799.000	Haier Smart Home Co Ltd - H Shares	5.287.173
7.278.000	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	5.279.154
191.082	ZTO Express Cayman Inc ADR	5.130.346
1.280.000	China Resources Land Ltd	5.114.127
1.190.500	China Merchants Bank Co Ltd - H Shares	4.718.151
660.000	Eve Energy Co Ltd Class A	4.385.902
6.698.000	China National Building Material Co Ltd – H Shares	4.254.914
5.299.600	Man Wah Holdings Ltd	4.215.779
1.757.400	China Pacific Insurance Group Co Ltd - H Shares	4.191.040
222.000	Meituan Class B	4.127.236
506.000	Midea Group Co Ltd Class A	3.806.964
850.000	Luxshare Precision Industry Co Ltd Class A	3.724.411
598.000	China Resources Beer Holdings Co Ltd	3.688.377
1.604.000	Satellite Chemical Co Ltd Class A	3.406.871
309.900	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	2.896.790
3.400.000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	2.799.434
66.000	Beijing Kingsoft Office Software Inc Class A	2.795.482
354.800	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A	2.750.853
1.304.000	SITC International Holdings Co Ltd	2.704.741
596.000	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd Class A	2.654.070
710.500	Li Ning Co Ltd	2.526.352
285.000	Yunnan Energy New Material Co Ltd Class A	2.367.673
495.922	Ninestar Corp Class A	2.316.383
2.208.000	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology Co Ltd Class A	1.953.569

Climate Innovation – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
6.435	Bureau Verita SA	178.781
5.164	GFL Environmental Inc	176.929
2.328	Procore Technologies Inc	176.787
3.222	nVent Electric Plc	175.324
3.228	Howmet Aerospace Inc	158.057
735	Quanta Services Inc	148.228
1.272	DSM-Firmenich AG	129.266
532	SolarEdge Technologies Inc	127.255
569	Trane Technologies Plc	113.442
1.576	Kia Corp	112.696
1.994	Corteva Inc	111.229
1.632	Ingersoll Rand Inc	106.995
3.130	Green Plains Inc	106.236
575	Air Liquide SA	102.361
3.000	BYD Co Ltd - H Shares	98.489
4.762	Stellantis NV	94.677
1.418	GXO Logistics Inc	94.180
1.400	Hitachi Ltd	92.762
272	ANSYS Inc	91.226
198	LG Chem Ltd	84.036
1.320	CRH Plc	78.527
470	L&F Co Ltd	76.820
675	ON Semiconductor Corp	72.995
650	Xylem Inc	72.841
1.676	ABB Ltd	66.095
5.339	Iberdrola SA	65.753
124	LG Energy Solution Ltd	54.244
513	Arkema SA	54.243
540	ITT Inc	54.087
170	Ferrari NV	54.000
322	Clean Harbors Inc	53.345
843	Danone SA	52.337
221	Union Pacific Corp	50.976
1.101	NEXTracker Inc Class A	42.680
790	Copart Inc	40.182
65	Adobe Inc	40.136

Climate Innovation – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
6.435	Bureau Verita SA	154.914
575	Air Liquide SA	106.664
1.994	Corteva Inc	92.504
1.418	GXO Logistics Inc	87.600
272	ANSYS Inc	84.682
170	Ferrari NV	51.242
532	SolarEdge Technologies Inc	39.642
354	ITT Inc	35.334
82	LG Chem Ltd	30.680
80	LG Energy Solution Ltd	28.618
84	Accenture Plc Class A	27.111
382	Ingersoll Rand Inc	27.064
54	Monolithic Power Systems Inc	25.648
1.679	Shoals Technologies Group Inc Class A	24.090
169	L&F Co Ltd	19.646
90	Trane Technologies Plc	18.783
1.600	Sungrow Power Supply Co Ltd Class A	17.896
334	ABB Ltd	14.399
287	Howmet Aerospace Inc	14.247
200	Hitachi Ltd	13.899
178	nVent Electric Plc	10.158

CLO Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
164.557	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF	15.057.896
2.043.974	iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF	10.329.645
5.500.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023	5.491.615
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/12/2023	4.997.077
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2024	4.994.934
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/11/2023	4.990.487
3.100.000	Blackrock European CLO XIV DAC Series 14X Class E, 11.61%, 15/07/2036	3.240.069
2.970.000	Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E, 11.05%, 15/05/2035	3.057.011
3.000.000	Symphony CLO 37 Ltd Series 2022-37X Class ER, 13.31%, 20/01/2037	3.000.000
3.000.000	Aurium CLO III DAC Series 3X Class E, 8.87%, 16/04/2030	2.997.375
3.000.000	Goldentree Loan Management US CLO 18 Ltd Series 2023-18X Class E, 12.93%, 20/01/2037	2.970.000
3.000.000	Bayswater Park CLO Ltd Series 2023-1X Class E, 12.74%, 20/01/2037	2.940.000
3.000.000	Euro-Galaxy VII CLO DAC Series 2019-7X Class ER, 10.16%, 25/07/2035	2.818.694
2.750.000	GoldenTree Loan Management EUR CLO 4 DAC Series 4X Class ER, 10.04%, 20/07/2034	2.657.189
2.500.000	AB BSL CLO 4 Ltd Series 2023-4X Class E, 13.48%, 20/04/2036	2.506.250
2.500.000	Canyon Capital CLO 2023-1 Ltd Series 2023-1X Class E, 13.39%, 15/10/2036	2.475.000
2.250.000	CVC Cordatus Loan Fund XXVI DAC Series 26X Class E, 12.36%, 15/01/2037	2.473.169
2.200.000	Symphony CLO 35 Ltd Series 2022-35X Class ER, 12.90%, 24/10/2036	2.200.000
2.200.000	Benefit Street Partners CLO XXXIII Ltd Series 2023-33X Class E, 7.64%, 25/01/2036	2.178.000
2.000.000	Palmer Square European Loan Funding 2023-1 DAC Series 2023-1X Class E, 10.53%, 15/11/2032	2.102.229
2.000.000	Voya CLO 2022-3 Ltd Series 2022-3X Class ER, 13.42%, 20/10/2036	2.000.000
2.000.000	AGL CLO 22 Ltd Series 2022-22X Class E, 13.95%, 20/10/2035	1.999.400
2.000.000	Symphony CLO 40 Ltd Series 2023-40X Class E, 13.13%, 14/01/2034	1.980.000
1.750.000	Adagio X Eur CLO DAC Series X-X Class ER, 12.26%, 20/10/2037	1.752.774
1.700.000	CVC Cordatus Loan Fund XXIII DAC Series 23X Class E, 11.22%, 25/04/2036	1.726.812
1.600.000	Wellington Management CLO 1 Ltd Series 2023-1X Class E, 13.05%, 20/10/2036	1.568.000
1.500.000	Avoca Static CLO I DAC Series 1X Class E, 10.97%, 15/10/2030	1.562.904
1.500.000	Bain Capital Credit CLO 2023-4 Ltd Series 2023-4X Class E, 13.58%, 21/10/2036	1.492.500
1.500.000	Avoca CLO XIII DAC Series 13X Class ERR, 10.16%, 15/04/2034	1.483.173
1.500.000	Armada Euro CLO V DAC Series 5X Class E, 9.92%, 28/07/2034	1.482.344
1.650.000	Vesey Park CLO DAC Series 1X Class E, 13.88%, 16/11/2032	1.481.563
1.500.000	OCP CLO 2023-26 Ltd Series 2023-26X Class E, 13.57%, 17/04/2036	1.477.500
1.500.000	MidOcean Credit CLO XI Ltd Series 2022-11X Class ER, 13.68%, 18/10/2033	1.470.000
1.500.000	Goldentree Loan Management EUR CLO 3 DAC Series 3X Class E, 9.88%, 20/01/2032	1.411.205
1.400.000	CVC Cordatus Loan Fund XXVII DAC Series 27X Class F, 14.32%, 15/04/2035	1.407.867
1.400.000	Aqueduct European CLO 7-2022 DAC Series 2022-7X Class E, 11.12%, 15/03/2036	1.394.840
1.500.000	Goldentree Loan Management EUR CLO 5 DAC Series 5X Class E, 9.22%, 20/04/2034	1.367.169
1.251.000	OCP Euro CLO 2029-3 Ltd Series 2019-3X Class ER, 9.99%, 20/04/2033	1.237.535

CLO Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
2.043.974	iShares USD Treasury Bond 0-1yr UCITS ETF	10.354.431
6.385.000	Octagon Investment Partners XV Ltd Series 2013-1X Class ER, 11.80%, 19/07/2030	5.298.273
4.000.000	Oha Loan Funding 2013-1 Ltd Series 2013-1X Class ER2, 9.82%, 23/07/2031	3.621.600
33.486	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF	3.008.382
3.000.000	Invesco CLO 2022-1 Ltd Series 2022-1X Class D, 8.10%, 20/04/2035	2.868.930
2.500.000	Palmer Square CLO Ltd Series 2020-3X Class ER, 13.23%, 15/11/2031	2.500.000
3.000.000	Dryden 49 Senior Loan Fund Series 2017-49X Class E, 11.09%, 18/07/2030	2.476.800
2.289.000	Providus CLO IV DAC Series 4X Class ER, 9.19%, 20/04/2034	2.314.136
2.500.000	Voya CLO 2015-1 Ltd Series 2015-1X Class DR, 10.44%, 18/01/2029	1.896.375
2.000.000	Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class E, 11.76%, 25/04/2033	1.821.660
2.000.000	Madison Park Funding XXX Ltd Series 2018-30X Class E, 10.53%, 15/04/2029	1.813.200
2.000.000	Burnham Park CLO Ltd Series 2016-1X Class ER, 10.65%, 20/10/2029	1.785.400
2.000.000	Dryden 60 CLO Ltd Series 2018-60X Class E, 11.18%, 15/07/2031	1.783.560
2.000.000	Cifc Funding 2018-I Ltd Series 2018-1X Class E, 10.56%, 18/04/2031	1.757.000
2.000.000	Ares XXXVII CLO Ltd Series 2015-4X Class DR, 11.73%, 15/10/2030	1.715.400
2.000.000	Carlyle Global Market Strategies Series 2014-2RX Class D, 10.99%, 15/05/2031	1.670.000
2.000.000	Chenango Park CLO Ltd Series 2018-1X Class D, 10.59%, 15/04/2030	1.593.100
1.485.000	Otranto Park CLO DAC Series 1X Class E, 11.05%, 15/05/2035	1.567.018
1.050.000	Cifc European Funding CLO III DAC Series 3X Class E, 8.79%, 15/01/2034	1.058.314
1.000.000	AGL CLO 22 Ltd Series 2022-22X Class E, 13.95%, 20/10/2035	1.005.180
1.000.000	Harvest CLO XXVII DAC Series 27X Class F, 12.03%, 15/07/2034	947.410
1.050.000	Galaxy XIX CLO Ltd Series 2015-19X Class D1R, 11.80%, 24/07/2030	924.462
1.000.000	BlackRock European CLO X DAC Series 10X Class FR, 12.02%, 15/10/2034	911.157
1.000.000	Avoca CLO XXVI Designated Activity Co Series 26X Class F, 13.06%, 15/04/2035	908.471
1.000.000	Long Point Park CLO Ltd Series 2017-1X Class D2, 10.39%, 17/01/2030	800.200

Commodities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
15.805.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2023	15.601.438
15.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024	14.890.396
13.550.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 28/09/2023	13.374.511
10.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/07/2023	9.880.170
10.135.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 25/01/2024	9.871.186
9.995.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 26/10/2023	9.867.947
10.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/02/2024	9.864.607
10.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023	9.844.391
10.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/02/2024	9.825.114
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 26/12/2023	4.937.442
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/01/2024	4.916.498
4.355.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 31/08/2023	4.296.899
3.755.000	Oracle Corp, 3.40%, 08/07/2024	3.683.432
3.711.000	AT&T Inc, 0.90%, 25/03/2024	3.601.972
3.397.000	Enterprise Products Operating LLC, 3.90%, 15/02/2024	3.363.343
3.082.000	Goldman Sachs Group Inc, 5.70%, 01/11/2024	3.080.490
3.015.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 28/11/2023	2.962.284
2.915.000	Citigroup Inc, 6.96%, 17/03/2026	2.939.303
2.920.000	Bank of America Corp, 6.48%, 25/04/2025	2.922.390
2.945.000	Apple Inc, 3.00%, 09/02/2024	2.913.665
2.845.000	Amazon.com Inc, 0.45%, 12/05/2024	2.739.605
2.415.000	US Bancorp, 2.40%, 30/07/2024	2.342.526
2.299.000	Amgen Inc, 3.63%, 22/05/2024	2.263.159
2.265.000	JPMorgan Chase & Co, 6.01%, 23/06/2025	2.257.184
2.075.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp, 5.70%, 18/10/2024	2.072.249
2.045.000	Morgan Stanley, 6.01%, 24/01/2025	2.040.323
2.095.000	Simon Property Group LP, 2.00%, 13/09/2024	2.025.098
2.000.000	American Express Co, 6.34%, 04/03/2025	2.006.861
2.000.000	Protective Life Global Funding, 6.42%, 28/03/2025	2.005.820
2.000.000	Volkswagen Group of America Finance LLC, 6.37%, 07/06/2024	2.003.434
2.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 29/06/2023	1.976.583
2.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023	1.973.452

Commodities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
9.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/06/2023	8.977.917
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024	5.965.875
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 26/12/2023	4.983.999
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2023	4.968.879
1.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023	993.839
675.000	Starbucks Corp, 5.82%, 14/02/2024	675.018
250.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023	249.517

Corporate Hybrid Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
83.700.000	Volkswagen International Finance NV, 7.50%, 29/12/2049	84.426.875
64.600.000	British Telecommunications Plc, 8.38%, 20/12/2083	75.111.500
59.100.000	Elia Group SA, 5.85%, 29/12/2049	59.136.361
51.300.000	Vattenfall AB, 6.88%, 17/08/2083	59.073.078
48.750.000	British Telecommunications Plc, 4.25%, 23/11/2081	40.950.318
45.000.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 7.25%, 29/12/2049	40.541.250
40.400.000	Bayer AG, 6.63%, 25/09/2083	40.068.328
38.000.000	Vodafone Group Plc, 6.50%, 30/08/2084	37.777.700
37.300.000	Bayer AG, 7.00%, 25/09/2083	37.142.032
37.000.000	APA Infrastructure Ltd, 7.13%, 09/11/2083	36.889.320
34.400.000	Vodafone Group Plc, 6.25%, 03/10/2078	31.317.685
30.600.000	Orange SA, 5.38%, 29/12/2049	30.405.990
30.100.000	Veolia Environnement SA, 5.99%, 29/12/2049	30.100.000
27.700.000	Enel SpA, 6.38%, 29/12/2049	28.012.000
35.000.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.38%, 31/08/2081	27.675.625
25.000.000	Orsted AS, 5.25%, 29/12/2049	24.760.000
36.371.000	Heimstaden Bostad AB, 2.63%, 29/12/2049	21.759.898
20.500.000	Iberdrola Finanzas SA, 4.88%, 29/12/2049	19.783.750
20.600.000	Vattenfall AB, 2.50%, 29/06/2083	19.520.814
20.000.000	Enbridge Inc, 8.25%, 15/01/2084	18.332.000
19.875.000	Stedin Holding NV, 1.50%, 29/12/2049	17.030.250
19.500.000	PPL Capital Funding Inc, 8.27%, 30/03/2067	16.448.290
15.000.000	Telefonica Europe BV, 7.13%, 29/12/2049	15.360.000
15.000.000	Electricite de France SA, 7.50%, 29/12/2049	15.342.500
16.860.000	Heimstaden Bostad AB, 3.25%, 29/12/2049	13.217.950
16.200.000	EDP - Energias de Portugal SA, 1.88%, 14/03/2082	12.250.500
12.079.000	BP Capital Markets Plc, 3.25%, 29/12/2049	11.342.813
10.940.000	Orange SA, 5.00%, 29/12/2049	10.940.000

Corporate Hybrid Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
53.700.000	Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 29/12/2049	47.699.875
50.100.000	Syensqo SA, 2.50%, 29/12/2049	44.731.900
51.500.000	Bayer AG, 3.13%, 12/11/2079	44.666.250
55.000.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.38%, 31/08/2081	43.986.250
44.400.000	Veolia Environnement SA, 2.50%, 29/12/2049	36.526.496
42.600.000	Evonik Industries AG, 1.38%, 02/09/2081	35.175.000
43.400.000	EDP - Energias de Portugal SA, 1.88%, 14/03/2082	33.087.500
34.310.000	TenneT Holding BV, 2.37%, 29/12/2049	32.139.550
75.750.000	AT Securities BV, 5.25%, 29/12/2049	30.390.866
30.600.000	Volkswagen International Finance NV, 4.63%, 29/12/2049	27.496.750
28.900.000	Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 29/12/2049	24.086.350
31.500.000	Paramount Global, 6.38%, 30/03/2062	23.652.349
28.100.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale, 2.38%, 29/12/2049	23.498.625
25.000.000	EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, 1.88%, 29/06/2080	22.530.000
18.800.000	Vattenfall AB, 6.88%, 17/08/2083	21.741.831
18.000.000	British Telecommunications Plc, 8.38%, 20/12/2083	20.974.829
20.800.000	Electricite de France SA, 5.88%, 29/12/2049	20.423.862
20.600.000	Vattenfall AB, 2.50%, 29/06/2083	19.019.814
17.700.000	Orsted AS, 5.25%, 29/12/2049	18.031.875
20.200.000	Veolia Environnement SA, 2.25%, 29/12/2049	17.937.900
19.000.000	Bayer AG, 2.38%, 12/11/2079	17.385.000
16.800.000	Elia Group SA, 2.75%, 29/12/2049	16.472.400
15.800.000	Electricite de France SA, 7.50%, 29/12/2049	16.225.750
17.100.000	Volkswagen International Finance NV, 3.50%, 29/12/2049	15.997.050
18.500.000	BP Capital Markets Plc, 3.63%, 29/12/2049	15.933.125
18.500.000	Rogers Communications Inc, 5.25%, 15/03/2082	15.422.202
14.100.000	Electricite de France SA, 6.00%, 29/12/2049	15.217.192
14.600.000	Elia Group SA, 5.85%, 29/12/2049	14.527.000
17.062.000	Southern Co, 1.88%, 15/09/2081	13.524.738
13.705.000	TotalEnergies SE, 1.75%, 29/12/2049	13.081.423
15.000.000	Volkswagen International Finance NV, 4.38%, 29/12/2049	12.412.500
13.100.000	Engie SA, 1.63%, 29/12/2049	12.035.625
12.900.000	Bertelsmann SE & Co KGaA, 3.50%, 23/04/2075	11.722.875
10.600.000	Orange SA, 5.38%, 29/12/2049	10.541.700
10.000.000	BP Capital Markets Plc, 4.25%, 29/12/2049	10.266.085

Developed Market FMP – 2027 – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
3.500.000	BPCE SA, 4.88%, 01/04/2026	3.360.610
3.600.000	Air Lease Corp, 3.63%, 01/04/2027	3.332.769
3.800.000	Santander UK Group Holdings Plc, 1.67%, 14/06/2027	3.328.423
3.600.000	Capital One Financial Corp, 3.65%, 11/05/2027	3.315.108
3.650.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 2.45%, 29/10/2026	3.272.789
3.600.000	HSBC Holdings Plc, 1.59%, 24/05/2027	3.196.318
3.175.000	Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 10/06/2026	3.196.288
3.400.000	Morgan Stanley, 3.95%, 23/04/2027	3.195.094
3.250.000	General Motors Financial Co Inc, 5.00%, 09/04/2027	3.160.233
3.300.000	Micron Technology Inc, 4.19%, 15/02/2027	3.127.799
3.200.000	UBS Group AG, 4.55%, 17/04/2026	3.089.273
3.300.000	Nationwide Building Society, 4.00%, 14/09/2026	3.077.421
3.250.000	Lloyds Banking Group Plc, 3.75%, 11/01/2027	3.049.520
3.500.000	Viatris Inc, 2.30%, 22/06/2027	3.047.695
3.400.000	Paramount Global, 2.90%, 15/01/2027	3.026.732
3.000.000	Imperial Brands Finance Plc, 6.13%, 27/07/2027	3.009.070
2.970.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 5.75%, 15/04/2026	2.902.924
3.080.000	Warnermedia Holdings Inc, 3.76%, 15/03/2027	2.867.313
2.795.000	Bank of America Corp, 4.25%, 22/10/2026	2.674.097
3.000.000	Global Payments Inc, 2.15%, 15/01/2027	2.669.784
3.000.000	BNP Paribas SA, 1.68%, 30/06/2027	2.666.670
2.800.000	American Tower Corp, 3.65%, 15/03/2027	2.621.691
3.000.000	Stellantis Finance US Inc, 1.71%, 29/01/2027	2.606.540
2.775.000	Rogers Communications Inc, 3.20%, 15/03/2027	2.561.630
2.650.000	HCA Inc, 4.50%, 15/02/2027	2.558.241
2.650.000	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp, 4.50%, 15/12/2026	2.552.756
2.650.000	Energy Transfer LP, 4.20%, 15/04/2027	2.518.011
2.675.000	NatWest Group Plc, 1.64%, 14/06/2027	2.372.837
2.125.000	Dell International LLC/EMC Corp, 4.90%, 01/10/2026	2.086.978
2.100.000	Boeing Co, 5.04%, 01/05/2027	2.072.931
2.215.000	Crown Castle Inc, 2.90%, 15/03/2027	2.027.813
2.075.000	MPLX LP, 4.13%, 01/03/2027	1.987.045
2.000.000	CNH Industrial Capital LLC, 1.45%, 15/07/2026	1.789.737
1.850.000	HP Inc, 3.00%, 17/06/2027	1.700.341
1.750.000	BAT Capital Corp, 4.70%, 02/04/2027	1.698.515
1.675.000	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer, 7.50%, 01/06/2025	1.684.581
1.725.000	Hess Corp, 4.30%, 01/04/2027	1.663.843
1.640.000	Vistra Operations Co LLC, 5.63%, 15/02/2027	1.587.067
1.700.000	Carrier Global Corp, 2.49%, 15/02/2027	1.547.752
1.635.000	Penn Entertainment Inc, 5.63%, 15/01/2027	1.537.084
1.425.416	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026	1.400.285
1.465.000.	New Fortress Energy Inc, 6.75%, 15/09/2025	1.397.719
1.475.000	Broadcom Inc, 3.46%, 15/09/2026	1.395.613

Developed Market FMP – 2027 – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
1.300.000	CNH Industrial Capital LLC, 1.45%, 15/07/2026	1.170.923
1.100.000	Fiserv Inc, 2.25%, 01/06/2027	982.707
825.000	Kinder Morgan Inc, 1.75%, 15/11/2026	737.088
500.000	Energy Transfer LP, 5.63%, 01/05/2027	478.950
315.000	Constellation Brands Inc, 4.35%, 09/05/2027	303.811
335.000	Otis Worldwide Corp, 2.29%, 05/04/2027	303.446

Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
31.209.000	Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034	30.729.183
99.430.000	Argentine Republic Government International Bond, 3.63%, 09/07/2035	30.599.149
28.783.000	Guatemala Government Bond, 6.60%, 13/06/2036	29.045.021
86.212.000	Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030	26.715.714
22.438.000	Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033	22.076.971
20.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 28/03/2023	19.927.677
16.087.000	Turkiye Government International Bond, 9.13%, 13/07/2030	15.978.865
15.039.000	Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035	15.404.847
15.379.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053	14.678.414
14.099.000	Costa Rica Government International Bond, 7.30%, 13/11/2054	13.554.024
13.390.000	Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033	12.411.730
11.428.000	Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.13%, 22/02/2033	12.281.024
19.505.000	El Salvador Government International Bond, 7.65%, 15/06/2035	11.102.425
16.570.000	Panama Government International Bond, 4.50%, 01/04/2056	10.680.840
10.489.000	Petrobras Global Finance BV, 6.50%, 03/07/2033	10.394.179
10.242.000	Panama Government International Bond, 6.85%, 28/03/2054	10.375.550
10.472.000	Chile Government International Bond, 4.95%, 05/01/2036	10.261.962
12.420.000	Nigeria Government International Bond, 9.25%, 21/01/2049	10.106.775
13.993.000	Nigeria Government International Bond, 8.25%, 28/09/2051	9.986.954
11.230.000	Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034	9.892.267
12.100.000	Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033	9.856.699
9.596.000	Turkiye Government International Bond, 9.38%, 14/03/2029	9.542.070
11.310.000	Nigeria Government International Bond, 8.75%, 21/01/2031	9.302.475
8.930.000	Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033	8.870.348
9.900.000	Romanian Government International Bond, 3.88%, 29/10/2035	8.691.727
10.240.000	Angolan Government International Bond, 8.75%, 14/04/2032	8.612.403

Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
99.458.675	Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030	33.245.699
103.917.910	Argentine Republic Government International Bond, 3.63%, 09/07/2035	26.945.044
26.060.000	Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033	23.846.114
19.083.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd, 3.38%, 29/12/2049	18.593.074
22.950.000	Petroleos Mexicanos, 7.69%, 23/01/2050	15.846.458
15.265.000	Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042	15.052.495
14.691.000	Paraguay Government International Bond, 4.95%, 28/04/2031	14.196.635
13.500.000	Southern Gas Corridor CJSC, 6.88%, 24/03/2026	13.688.520
15.750.000	Egypt Government International Bond, 8.70%, 01/03/2049	11.305.665
12.170.000	Saudi Arabian Oil Co, 4.25%, 16/04/2039	10.550.497
10.887.000	Oman Government International Bond, 6.75%, 17/01/2048	10.491.890
11.940.000	Republic of Kenya Government International Bond, 8.00%, 22/05/2032	10.306.926
13.699.000	Angolan Government International Bond, 9.13%, 26/11/2049	10.180.751
12.747.000	Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033	10.116.743
7.800.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	9.596.816
19.123.467	Ecuador Government International Bond, 6.00%, 31/07/2030	9.586.129
8.930.000	Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033	9.460.641
10.018.000	Republic of Uzbekistan International Bond, 5.38%, 20/02/2029	9.246.187
12.028.000	Turkey Government International Bond, 6.00%, 14/01/2041	9.140.932
12.589.000	Colombia Government International Bond, 5.00%, 15/06/2045	8.751.633
12.100.000	Republic of South Africa Government International Bond, 5.75%, 30/09/2049	8.496.954
10.849.000	Colombia Government International Bond, 3.00%, 30/01/2030	8.477.261
8.973.750	Iraq International Bond, 5.80%, 15/01/2028	8.408.668
9.432.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031	8.209.336
8.022.000	Mongolia Government International Bond, 8.75%, 09/03/2024	8.070.599
11.262.000	Republic of Kenya Government International Bond, 8.25%, 28/02/2048	7.774.790
7.595.000	First Abu Dhabi Bank PJSC, 6.32%, 04/04/2034	7.702.849
23.087.184	Argentine Republic Government International Bond, 1.00%, 09/07/2029	7.648.067

Emerging Market Debt - Local Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
1.035.931.925	Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031	47.399.374
667.331.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033	45.064.388
39.853.600	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023	39.407.275
40.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023	39.099.606
122.011.000	Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028	31.442.150
103.835.300.000	Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033	27.756.892
587.553.766	Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035	27.546.839
26.024.800	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023	25.434.587
24.708.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023	24.291.986
9.435.460.000	Hungary Government Bond, 4.75%, 24/11/2032	23.189.701
392.690.000	Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033	20.802.369
114.491.000	Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032	20.703.500
4.206.696.000	Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025	18.976.927
416.857.507	Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 31/01/2044	18.838.513
17.716.200	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2024	17.440.709
17.621.100	United States Treasury Bill, 0.00%, 29/02/2024	17.239.031
318.866.689	Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026	16.766.627
401.939.545	Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 28/02/2048	16.700.178
477.597.049	Republic of South Africa Government Bond, 6.25%, 31/03/2036	15.976.525
67.398.000	Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042	15.680.949
5.807.160.000	Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028	15.192.341
523.577.000	Thailand Government Bond, 3.35%, 17/06/2033	15.087.508
220.290.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.13%, 15/06/2038	14.912.223
273.118.642	Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025	14.794.118
781.360.000	Philippine Government Bond, 6.75%, 15/09/2032	14.014.373
57.075.000	Malaysia Government Bond, 4.89%, 08/06/2038	13.881.223
55.140.000	Romania Government Bond, 4.40%, 25/09/2023	12.194.570
493.856.000	Uruguay Government International Bond, 8.50%, 15/03/2028	11.766.744
80.000.000	China Development Bank, 3.30%, 03/03/2026	11.758.537
272.154.491	Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037	11.163.600
173.110.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/02/2034	11.121.923

Emerging Market Debt - Local Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
1.277.070.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	65.195.375
1.242.505.692	Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035	55.096.055
1.112.795.378	Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031	50.635.323
1.119.819.047	Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037	48.261.624
39.853.600	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023	39.762.757
40.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023	39.616.669
584.621.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033	39.293.991
175.207.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	35.678.875
482.683.530	Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026	29.651.427
26.024.800	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023	25.595.391
4.206.696.000	Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025	20.754.908
291.739.176	Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025	19.713.645
587.994.000	Thailand Government Bond, 1.45%, 17/12/2024	17.861.687
97.612.900.000	Colombian TES, 7.00%, 26/03/2031	17.618.097
17.621.100	United States Treasury Bill, 0.00%, 29/02/2024	17.427.336
5.807.160.000	Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028	15.593.181
57.795.300.000	Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033	15.513.999
509.670.000	Thailand Government Bond, 2.40%, 17/12/2023	15.307.096
213.305.000.000	Indonesia Treasury Bond, 8.13%, 15/05/2024	14.572.442
344.310.000	Czech Republic Government Bond, 2.40%, 17/09/2025	14.492.410
485.120.000	Thailand Government Bond, 2.00%, 17/12/2031	13.193.284
55.140.000	Romania Government Bond, 4.40%, 25/09/2023	12.447.139
67.215.000	Republic of Poland Government Bond, 0.25%, 25/10/2026	12.327.025
289.994.714	Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 31/01/2044	12.241.347

Emerging Market Debt Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
148.618.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033	10.121.580
220.312.572	Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031	10.042.718
28.137.000	Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028	7.276.636
24.881.600.000	Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033	6.678.244
122.707.805	Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035	5.765.897
29.163.000	Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032	5.284.742
93.410.100	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	5.091.837
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023	4.887.451
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024	4.886.861
1.950.450.000	Hungary Government Bond, 4.75%, 24/11/2032	4.756.757
4.459.200	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023	4.358.070
105.368.165	Republic of South Africa Government Bond, 8.75%, 28/02/2048	4.327.629
76.539.832	Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026	4.078.738
113.833.220	Republic of South Africa Government Bond, 6.25%, 31/03/2036	3.833.267
69.240.000	Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033	3.676.416
125.484.000	Thailand Government Bond, 3.35%, 17/06/2033	3.661.649
67.630.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	3.607.911
15.151.000	Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042	3.506.194
69.430.000	Mexican Bonos, 5.50%, 04/03/2027	3.402.624
1.209.860.000	Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028	3.193.631
707.876.000	Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025	3.193.316
45.979.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.13%, 15/06/2038	3.136.152
57.445.500	Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025	3.130.591
12.900.000	Malaysia Government Bond, 4.89%, 08/06/2038	3.114.771
163.720.000	Philippine Government Bond, 6.75%, 15/09/2032	2.936.254
44.347.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029	2.840.567
10.835.000	Peru Government Bond, 6.15%, 12/08/2032	2.771.685

Emerging Market Debt Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
248.469.039	Republic of South Africa Government Bond, 8.88%, 28/02/2035	11.016.375
199.915.095	Republic of South Africa Government Bond, 8.50%, 31/01/2037	8.540.737
158.150.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	8.127.911
179.163.271	Republic of South Africa Government Bond, 7.00%, 28/02/2031	7.936.244
38.034.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	7.864.220
104.970.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033	7.072.622
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024	4.977.385
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023	4.936.875
4.459.200	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023	4.385.623
21.221.000	Republic of Poland Government Bond, 2.75%, 25/10/2029	3.921.665
68.221.000	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	3.829.779
71.997.400	Mexican Bonos, 7.50%, 03/06/2027	3.819.636
54.376.000.000	Indonesia Treasury Bond, 8.13%, 15/05/2024	3.720.292
707.876.000	Mexico Cetes, 0.00%, 06/02/2025	3.492.504
50.721.840	Turkey Government Bond, 1.50%, 18/06/2025	3.460.105
1.209.860.000	Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028	3.249.103
11.923.200.000	Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033	3.192.880
53.664.271	Republic of South Africa Government Bond, 10.50%, 21/12/2026	3.185.228
98.000.000	Thailand Government Bond, 2.00%, 17/12/2031	2.644.861
91.000.000	Thailand Government Bond, 2.65%, 17/06/2028	2.604.131
11.200.000	Malaysia Government Bond, 3.80%, 17/08/2023	2.596.808

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
16.632.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033	1.135.922
1.100.000	Mexico Government International Bond, 6.35%, 09/02/2035	1.079.914
1.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/10/2023	991.817
1.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023	982.684
1.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024	976.914
700.000	Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036	755.650
750.000	Panama Bonos del Tesoro, 6.38%, 25/07/2033	743.690
710.000	Indonesia Government International Bond, 1.40%, 30/10/2031	619.472
665.000	Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034	591.741
460.000	Philippine Government International Bond, 9.50%, 02/02/2030	589.950
586.800	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/05/2023	580.228
2.010.000	Republic of Poland Government Bond, 7.50%, 25/07/2028	520.447
1.830.800.000	Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033	490.101
2.507.000	Republic of Poland Government Bond, 1.75%, 25/04/2032	451.726
410.000	Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.13%, 22/02/2033	444.913
16.000.000	Thailand Government Bond, 0.75%, 17/09/2024	432.161
6.270.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.13%, 15/06/2038	427.880
588.000	Panama Government International Bond, 4.50%, 19/01/2063	423.003
1.736.000	Malaysia Government Bond, 4.70%, 15/10/2042	405.337
13.168.000	Thailand Government Bond, 3.35%, 17/06/2033	393.446
5.700.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.88%, 15/04/2029	361.501
6.850.000	Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033	358.876
1.267.000	Peru Government Bond, 6.15%, 12/08/2032	318.889
126.050.000	Hungary Government Bond, 4.75%, 24/11/2032	312.741
400.000	Kazakhstan Government International Bond, 1.50%, 30/09/2034	311.196
116.760.000	Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028	309.194

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
1.142.000	Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036	1.191.039
1.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/10/2023	993.992
1.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023	984.780
1.100.000	Chile Government International Bond, 0.83%, 02/07/2031	941.706
11.983.400	Mexican Bonos, 8.50%, 31/05/2029	670.724
9.706.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033	652.146
841.000	Mexico Government International Bond, 2.25%, 12/08/2036	647.227
430.000	Panama Government International Bond, 9.38%, 01/04/2029	513.794
400.000	Philippine Government International Bond, 9.50%, 02/02/2030	484.286
2.293.000	Republic of Poland Government Bond, 2.50%, 25/07/2026	470.916
540.000	Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033	431.640
300.000	Peruvian Government International Bond, 8.75%, 21/11/2033	358.989
340.000	Indonesia Government International Bond, 3.75%, 14/06/2028	354.785
300.000	Indonesia Government International Bond, 6.63%, 17/02/2037	339.453
6.620.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	333.763
2.240.000	China Government Bond, 3.28%, 03/12/2027	323.099
290.000	Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033	300.585
250.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	299.058
284.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053	285.789
9.900.000	Thailand Government Bond, 2.65%, 17/06/2028	282.439
99.150.000	Hungary Government Bond, 6.75%, 22/10/2028	266.313
300.000	Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110	263.166
245.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.75%, 16/11/2032	259.700
981.100.000	Colombian TES, 13.25%, 09/02/2033	257.875

Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
85.703	Samsung Electronics Co Ltd	4.221.130
45.113	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	4.149.085
81.200	Tencent Holdings Ltd	3.609.277
229.600	Alibaba Group Holding Ltd	2.653.415
27.699	PDD Holdings Inc ADR	2.526.515
36.735	Rio Tinto Plc	2.463.851
459.300	Bangkok Bank PCL	2.160.451
546.520	NARI Technology Co Ltd Class A	2.051.741
637.600	CITIC Securities Co Ltd Class A	1.985.107
3.226.000	China Construction Bank Corp - H Shares	1.908.870
200.918	Banco do Brasil SA	1.908.232
101.486	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV Class B	1.854.122
800.340	BDO Unibank Inc	1.839.533
184.400	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	1.808.692
107.260	SM Investments Corp	1.784.300
244.000	Li Ning Co Ltd	1.784.256
439.800	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	1.779.108
208.770	Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O	1.771.169
197.500	Midea Group Co Ltd Class A	1.608.092
50.000	BYD Co Ltd Class H	1.577.696
41.821	Trip.com Group Ltd ADR	1.533.948
3.297	NVIDIA Corp	1.521.178
175.634	Hypermarcas SA	1.478.397
335.000	Hua Hong Semiconductor Ltd	1.474.610
1.900.303	Adnoc Gas Plc	1.444.957
24.463	Las Vegas Sands Corp	1.411.258
979.000	China Longyuan Power Group Corp Ltd - H Shares	1.376.487
79.800	Sungrow Power Supply Co Ltd Class A	1.272.907
10.334	Baidu Inc ADR	1.255.780
898.612	Bharat Electronics Ltd	1.252.896
16.004	SK Hynix Inc	1.249.586
53.904	Samsung Engineering Co Ltd	1.240.379
138.000	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares	1.233.026

Emerging Markets Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
159.259	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	14.256.879
236.700	Tencent Holdings Ltd	10.595.332
148.526	Samsung Electronics Co Ltd	7.527.371
568.200	Alibaba Group Holding Ltd	6.676.177
550.371	ICICI Bank Ltd	6.079.904
192.945	JD.com Inc Class A	4.378.749
119.304	Reliance Industries Ltd	3.497.327
872.942	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	3.407.075
6.901	LG Chem Ltd	3.387.624
171.781	HDFC Bank Ltd	3.361.041
487.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd - H Shares	3.171.608
89.308	Trip.com Group Ltd ADR	3.157.369
31.900	Dino Polska SA	3.055.610
435.562	State Bank of India	3.051.140
562.727	Itau Unibanco Holding SA	2.957.986
747.000	Chunghwa Telecom Co Ltd	2.897.480
769.800	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	2.854.248
37.406	SK Hynix Inc	2.832.763
1.201.000	Uni-President Enterprises Corp	2.790.733
87.712	Anglo American Plc	2.790.207
315.439	Saudi Arabian Oil Co	2.765.859
10.200	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	2.589.199
669.000	China Mengniu Dairy Co Ltd	2.529.024
145.540	Meituan Class B	2.527.255
616.364	Sichuan Kelun Pharmaceutical Co Ltd Class A	2.509.472
17.373	Credicorp Ltd	2.359.376
106.589	Bid Corp Ltd	2.340.379

Emerging Markets Select Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
171.913	Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O	1.445.185
127.161	Axis Bank Ltd	1.424.997
162.000	Midea Group Co Ltd Class A	1.320.800
179.000	Li Ning Co Ltd	1.306.274
130.900	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd Class A	1.281.518
14.006	PDD Holdings Inc ADR	1.243.403
73.800	Sungrow Power Supply Co Ltd Class A	1.185.159
36.500	BYD Co Ltd - H Shares	1.147.675
16.366	Rio Tinto Plc	1.111.893
290.600	NARI Technology Co Ltd Class A	1.098.266
48.480	Samsung Engineering Co Ltd	1.088.915
335.100	CITIC Securities Co Ltd Class A	1.043.862
17.275	Las Vegas Sands Corp	1.013.825
207.900	Bangkok Bank PCL	998.485
94.169	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV Class B	991.369
143.000	Galaxy Entertainment Group Ltd	988.029
32.797	Larsen & Toubro Ltd	983.165
157.000	Chroma ATE Inc	965.286
6.258	Baidu Inc ADR	945.061
359.500	Foxconn Industrial Internet Co Ltd Class A	818.575
416.480	FIBRA Macquarie Mexico	776.725
17.913	Dixon Technologies India Ltd	768.675
27.242	Al-Dawaa Medical Services Co	765.697
17.531	H World Group Ltd ADR	755.595
89.103	Hypera SA	754.176
4.100	Naspers Ltd	724.509
42.630	SM Investments Corp	719.913
304.220	BDO Unibank Inc	690.278
174.700	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	667.661
4.082	Globant SA	652.237
72.000	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares	645.679
909.246	Borouge Plc	641.328
51.283	Saudi National Bank	582.956
10.319	Samsung Electronics Co Ltd	530.889
41.800	Alibaba Group Holding Ltd	471.543
64.000	E Ink Holdings Inc	446.879
139.089	Aptus Value Housing Finance India Ltd	418.404

Emerging Markets Select Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
513.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	8.938.432
134.600	Tencent Holdings Ltd	5.752.760
105.796	Samsung Electronics Co Ltd	5.460.474
351.120	Alibaba Group Holding Ltd	4.192.100
150.180	ICICI Bank Ltd ADR	3.526.325
105.350	JD.com Inc Class A	2.379.404
25.561	SK Hynix Inc	2.318.346
75.313	Reliance Industries Ltd	2.281.846
17.662	Dino Polska SA	1.851.479
459.686	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	1.798.354
6.600	Kweichow Moutai Co Ltd Class A	1.701.354
25.047	HDFC Bank Ltd ADR	1.663.564
43.695	Trip.com Group Ltd ADR	1.613.410
176.888	Tsingtao Brewery Co Ltd - H Shares	1.599.774
689.000	Uni-President Enterprises Corp	1.565.419
91.816	IndusInd Bank Ltd	1.562.408
69.092	Bid Corp Ltd	1.527.040
171.913	Grupo Financiero Banorte SAB de CV Class O	1.466.977
127.161	Axis Bank Ltd	1.462.353
391.100	Bank of Ningbo Co Ltd Class A	1.461.430
2.014.449	Borouge Plc	1.461.420
3.038	LG Chem Ltd	1.455.865
8.036	Naspers Ltd	1.377.642
22.538	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	1.366.814
157.000	Chroma ATE Inc	1.361.256
494.964	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	1.335.814
48.480	Samsung Engineering Co Ltd	1.322.353

Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
400.000	Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031	396.817
320.000	Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033	315.777
300.000	European Union, 3.25%, 04/07/2034	295.573
200.000	BNP Paribas SA, 7.38%, 29/12/2049	200.000
200.000	Intesa Sanpaolo SpA, 6.18%, 20/02/2034	200.000
200.000	NatWest Group Plc, 5.76%, 28/02/2034	200.000
200.000	Morgan Stanley, 4.66%, 02/03/2029	200.000
200.000	JPMorgan Chase & Co, 4.46%, 13/11/2031	200.000
200.000	National Gas Transmission Plc, 4.25%, 05/04/2030	199.928
200.000	Banco BPM SpA, 6.00%, 14/06/2028	199.910
200.000	Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029	199.636
200.000	HSBC Holdings Plc, 4.79%, 10/03/2032	199.590
215.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1.70%, 15/08/2032	199.500
200.000	Linde Plc, 3.63%, 12/06/2034	199.410
200.000	Caixa Central de Credito Agricola Mutuo CRL, 8.38%, 04/07/2027	199.362
200.000	Athora Holding Ltd, 6.63%, 16/06/2028	199.322
200.000	Thales SA, 4.13%, 18/10/2028	199.212
200.000	Heathrow Funding Ltd, 4.50%, 11/07/2033	199.180
200.000	BPCE SA, 4.75%, 14/06/2034	199.158
200.000	VF Corp, 4.25%, 07/03/2029	199.140

Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
300.000	Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031	299.947
200.000	Telecom Italia SpA, 6.88%, 15/02/2028	203.301
200.000	HSBC Holdings Plc, 4.79%, 10/03/2032	201.591
200.000	Morgan Stanley, 4.66%, 02/03/2029	201.110
200.000	JPMorgan Chase & Co, 4.46%, 13/11/2031	201.083
200.000	BPCE SA, 4.75%, 14/06/2034	200.967
200.000	National Gas Transmission Plc, 4.25%, 05/04/2030	200.920
200.000	Intesa Sanpaolo SpA, 5.13%, 29/08/2031	200.820
200.000	Engie SA, 4.50%, 06/09/2042	200.720
200.000	Banco BPM SpA, 6.00%, 14/06/2028	200.684
200.000	Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029	200.636
200.000	NatWest Group Plc, 5.76%, 28/02/2034	200.512
200.000	CRH SMW Finance DAC, 4.25%, 11/07/2035	200.408
200.000	ZF Europe Finance BV, 6.13%, 13/03/2029	200.365
200.000	BNP Paribas SA, 7.38%, 29/12/2049	200.160
200.000	Linde Plc, 3.63%, 12/06/2034	200.004
200.000	VF Corp, 4.25%, 07/03/2029	199.845
200.000	Caixa Central de Credito Agricola Mutuo CRL, 8.38%, 04/07/2027	199.770
200.000	Heathrow Funding Ltd, 4.50%, 11/07/2033	199.720
200.000	Sartorius Finance BV, 4.50%, 14/09/2032	199.608

Euro Bond Absolute Return – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
1.847.000	Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033	1.828.430
7.400.000	Republic of Poland Government Bond, 6.00%, 25/10/2033	1.618.165
1.600.000	Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031	1.588.106
1.517.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.40%, 28/03/2025	1.507.004
1.500.000	Bundesobligation, 2.20%, 13/04/2028	1.494.810
1.380.000	European Union, 3.25%, 04/07/2034	1.359.815
10.000.000	Nykredit Realkredit AS, 4.00%, 01/10/2053	1.307.210
1.300.000	Slovenia Government Bond, 1.19%, 14/03/2029	1.157.368
1.035.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.40%, 01/05/2033	1.057.642
1.000.000	Morgan Stanley, 4.66%, 02/03/2029	1.000.000
1.000.000	Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029	998.180
1.000.000	VF Corp, 4.25%, 07/03/2029	995.700
1.001.000	Spain Government Bond, 3.15%, 30/04/2033	995.528
1.000.000	Intesa Sanpaolo SpA, 5.63%, 08/03/2033	992.540
946.000	Slovakia Government Bond, 3.75%, 23/02/2035	931.867
7.000.000	Nykredit Realkredit AS, 5.00%, 01/10/2053	930.745
905.093	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	891.591
865.312	French Republic Government Bond OAT, 0.60%, 25/07/2034	861.736
800.000	NatWest Group Plc, 5.76%, 28/02/2034	800.000
800.000	JPMorgan Chase & Co, 4.46%, 13/11/2031	800.000

Euro Bond Absolute Return – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
1.747.988	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.40%, 26/05/2025	1.723.422
1.617.000	Slovakia Government Bond, 4.00%, 19/10/2032	1.686.262
1.500.000	Bundesobligation, 2.20%, 13/04/2028	1.476.343
1.618.457	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT, 1.65%, 16/07/2032	1.414.887
1.260.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 3.40%, 28/03/2025	1.259.252
8.917.955	Nykredit Realkredit AS, 5.00%, 01/10/2053	1.202.599
1.200.000	Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031	1.196.838
1.035.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4.40%, 01/05/2033	1.056.701
1.000.000	Morgan Stanley, 4.66%, 02/03/2029	1.005.551
1.000.000	Toyota Motor Credit Corp, 4.05%, 13/09/2029	1.003.180
1.000.114	European Union, 3.25%, 04/07/2034	1.002.709
1.000.000	VF Corp, 4.25%, 07/03/2029	999.225
1.000.000	Italy Buoni Ordinari del Tesoro BOT, 0.00%, 28/02/2023	997.780
1.000.000	Intesa Sanpaolo SpA, 5.63%, 08/03/2033	988.250
1.001.000	Spain Government Bond, 3.15%, 30/04/2033	982.751
950.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1.75%, 30/05/2024	936.250
900.000	Spain Government Bond, 3.55%, 31/10/2033	926.270
946.000	Slovakia Government Bond, 3.75%, 23/02/2035	919.762
905.691	French Republic Government Bond OAT, 0.10%, 25/07/2031	887.965
865.372	French Republic Government Bond OAT, 0.60%, 25/07/2034	867.166

European High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
6.920.000	Lorca Telecom Bondco SA, 4.00%, 18/09/2027	6.474.173
5.650.000	Bellis Acquisition Co Plc, 3.25%, 16/02/2026	5.791.234
5.785.000	Douglas GmbH, 6.00%, 08/04/2026	5.589.977
4.667.000	Telecom Italia SpA, 7.88%, 31/07/2028	4.853.068
4.600.000	EDP - Energias de Portugal SA, 5.94%, 23/04/2083	4.609.674
4.500.000	Abertis Infraestructuras Finance BV, 3.25%, 29/12/2049	4.176.248
5.000.000	Cellnex Telecom SA, 1.75%, 23/10/2030	4.133.710
3.850.000	Mobico Group Plc, 4.25%, 29/12/2049	3.871.282
3.770.000	Telecom Italia SpA, 4.00%, 11/04/2024	3.747.433
3.625.000	Dana Financing Luxembourg Sarl, 8.50%, 15/07/2031	3.742.616
3.772.000	Motion Finco Sarl, 7.38%, 15/06/2030	3.733.637
4.845.000	Ziggo Bond Co BV, 3.38%, 28/02/2030	3.728.862
4.200.000	Electricite de France SA, 2.63%, 29/12/2049	3.532.264
3.349.000	IHO Verwaltungs GmbH, 8.75%, 15/05/2028	3.493.878
3.400.000	Multiversity SRL, 8.20%, 30/10/2028	3.402.426
4.200.000	CECONOMY AG, 1.75%, 24/06/2026	3.332.653
2.869.000	Pinnacle Bidco Plc, 10.00%, 11/10/2028	3.300.604
3.165.000	Forvia SE, 7.25%, 15/06/2026	3.292.684
3.350.000	Birkenstock Financing Sarl, 5.25%, 30/04/2029	3.250.095
3.920.000	UGI International LLC, 2.50%, 01/12/2029	3.241.242

European High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
1.350.000	Sigma Holdco BV, 5.75%, 15/05/2026	1.129.720
1.010.000	Ford Motor Credit Co LLC, 4.87%, 03/08/2027	1.037.856
930.000	Ford Motor Credit Co LLC, 3.02%, 06/03/2024	919.340
900.000	Deutsche Lufthansa AG, 3.00%, 29/05/2026	854.659
800.000	ZF Finance GmbH, 3.00%, 21/09/2025	770.000
750.000	thyssenkrupp AG, 2.88%, 22/02/2024	741.750
742.000	Bormioli Pharma SpA, 8.81%, 15/05/2028	733.585
682.000	Emerald Debt Merger Sub, 6.38%, 15/12/2030	678.011
794.000	TI Automotive Finance Plc, 3.75%, 15/04/2029	666.678
655.000	Adevinta ASA, 3.00%, 15/11/2027	624.479
640.000	IQVIA Inc, 2.88%, 15/09/2025	619.200
560.000	Marks & Spencer Plc, 3.75%, 19/05/2026	618.971
600.000	Air France-KLM, 8.13%, 31/05/2028	608.766
605.000	Clarios Global LP/Clarios US Finance Co, 4.38%, 15/05/2026	577.019
700.000	Virgin Media Finance Plc, 3.75%, 15/07/2030	567.000
750.000	Altice France Holding SA, 8.00%, 15/05/2027	563.517
590.000	Kronos International Inc, 3.75%, 15/09/2025	556.413
515.000	Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc, 8.25%, 31/07/2025	553.115
545.000	Motion Finco Sarl, 7.38%, 15/06/2030	534.781
500.000	Azelis Finance, 5.75%, 15/03/2028	504.000
560.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 2.88%, 30/04/2028	489.373
485.000	Banijay Entertainment SASU, 7.00%, 01/05/2029	480.393
434.000	AA Bond Co Ltd, 7.38%, 31/07/2029	473.516
467.000	Telecom Italia SpA, 6.88%, 15/02/2028	464.217
455.000	Benteler International Aktiengesellschaft, 9.38%, 15/05/2028	456.775

European Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
31.155	EssilorLuxottica SA	5.448.372
12.350	L'Oreal SA	4.970.609
15.524	Ferrari NV	4.365.688
106.131	Netcompany Group A/S	3.765.527
113.197	RELX Plc	3.630.468
3.866	Adyen NV	3.561.611
37.526	London Stock Exchange Group Plc	3.430.593
29.036	Reply SpA	2.963.125
158.106	CVS Group Plc	2.791.927
22.801	SolarEdge Technologies Inc	2.455.008
104.083	3i Group Plc	2.432.497
25.363	Novo Nordisk A/S Class B	2.351.128
19.559	Nestle SA	2.165.014
4.967	Kering SA	2.099.719
11.737	Schneider Electric SE	1.913.451
20.460	DiaSorin SpA	1.836.733
27.795	Alfen NV	1.808.505
44.988	Cellnex Telecom SA	1.699.696
2.495	ASML Holding NV	1.524.663
20.930	Euronext NV	1.328.834
46.671	Zalando SE	1.088.280

European Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
383.962	3i Group Plc	8.192.869
168.818	Cellnex Telecom SA	5.917.343
415.885	Atlas Copco AB Class A	5.531.330
124.114	Dechra Pharmaceuticals Plc	5.218.733
4.204	Adyen NV	4.653.124
44.399	London Stock Exchange Group Plc	4.338.578
77.311	Amundi SA	4.239.249
9.893	Tecan Group AG	3.719.134
6.894	Kering SA	3.717.234
125.353	HelloFresh SE	3.220.097
23.234	Straumann Holding AG	3.114.418
20.721	Novo Nordisk A/S Class B	3.044.428
48.121	Scout24 SE	2.856.903
2.732	Partners Group Holding AG	2.716.631
8.392	Ferrari NV	2.700.670
4.278	ASML Holding NV	2.687.019
6.929	VAT Group AG	2.539.139
23.095	Nestle SA	2.474.058
63.349	Zalando SE	2.447.794
10.483	Sartorius Stedim Biotech	2.370.875
99.974	Assa Abloy AB Class B	2.226.079
12.449	Schneider Electric SE	1.965.988
4.604	L'Oreal SA	1.890.375
26.254	Euronext NV	1.868.694
133.595	TeamViewer SE	1.865.266
33.931	Alfen NV	1.826.054
24.482	Bakkafrost P/F	1.411.152
54.979	CVS Group Plc	1.188.243
8.469	Beiersdorf AG	1.034.547

Event Driven – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
8.650.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 31/08/2023	8.531.968
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/04/2024	6.874.668
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/01/2024	6.871.097
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024	6.863.872
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024	6.861.813
7.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 25/01/2024	6.859.285
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 19/03/2024	5.929.827
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2023	5.898.845
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/04/2024	5.896.768
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 22/02/2024	5.863.303
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 21/03/2024	5.862.438
6.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 29/02/2024	5.857.170
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/04/2024	4.916.311
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/04/2024	4.914.056
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 28/03/2024	4.902.589
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/12/2023	4.902.022
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/04/2024	4.897.902
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 21/12/2023	4.896.923
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/02/2024	4.893.096
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 28/12/2023	4.891.991
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 08/02/2024	4.888.129
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 15/02/2024	4.883.122
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/03/2024	4.880.739
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/03/2024	4.880.390
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023	3.942.926
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 19/09/2023	3.941.188
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/08/2023	3.941.140
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/09/2023	3.940.881
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023	3.938.119
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023	3.937.768
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/09/2023	3.936.444
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 26/09/2023	3.935.935
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2023	3.931.796
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/11/2023	3.927.229
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/11/2023	3.919.079
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024	2.978.079
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2024	2.976.832
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/03/2023	2.969.995
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023	2.953.508
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2023	2.951.640
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/07/2023	2.951.072
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 22/06/2023	2.950.704

Event Driven – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/07/2023	2.949.845
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/10/2023	2.949.550
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 03/10/2023	2.948.704
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 29/06/2023	2.948.008
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/07/2023	2.946.934
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/11/2023	2.942.751
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/11/2023	2.942.705
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2023	2.939.573
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/12/2023	2.939.309
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/04/2023	2.770.306
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023	2.758.322
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023	2.757.640
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023	2.757.591
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023	2.756.429
2.800.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2023	2.755.893

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
18.900	ARM Holdings Plc ADR	1.060.290
19.059	Kenvue Inc	486.576
8.800	Maplebear Inc	369.600
4.736	CAVA Group Inc	198.912
6.315	Nextracker Inc Class A	191.408
4.000	Klaviyo Inc	147.000
5.912	Savers Value Village Inc	146.440
1.427	ODDITY Tech Ltd Class A	70.066
1.136	ACELYRIN Inc	26.128

Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
4.746.920	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1.63%, 15/10/2027	4.834.558
2.595.000	United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 15/11/2032	2.727.196
2.500.000	State of Hesse, 2.88%, 04/07/2033	2.725.318
3.580.000	Canadian Government Bond, 3.00%, 01/11/2024	2.589.112
2.503.000	United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 31/01/2028	2.484.675
2.465.000	United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/05/2033	2.382.589
2.330.000	United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/02/2033	2.308.672
28.806.000.000	Indonesia Treasury Bond, 6.63%, 15/05/2033	1.940.961
1.670.000	Land Berlin, 3.00%, 11/07/2031	1.807.568
1.500.000	Gemeinsame Deutsche Bundeslaender, 3.00%, 26/04/2030	1.631.447
1.630.000	United States Treasury Note/Bond, 3.63%, 15/02/2053	1.590.895
1.505.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/03/2054	1.524.545
1.130.000	United Kingdom Gilt, 4.75%, 07/12/2030	1.505.629
1.320.000	Bundesobligation, 2.40%, 19/10/2028	1.450.108
1.300.000	State of Brandenburg, 3.00%, 20/07/2033	1.443.308
1.490.000	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/08/2033	1.437.428
10.100.000	Nykredit Realkredit AS, 4.00%, 01/10/2053	1.402.975
1.240.732	United Kingdom Gilt, 3.75%, 22/10/2053	1.362.512
1.236.000	Autonomous Community of Madrid Spain, 3.60%, 30/04/2033	1.359.268
1.360.000	French Republic Government Bond OAT, 0.75%, 25/05/2028	1.308.191

Global Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
11.488.000	Canadian Government Bond, 3.00%, 01/11/2024	8.377.134
4.763.127	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1.63%, 15/10/2027	4.780.586
3.415.000	United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 15/11/2032	3.548.502
4.202.104	Canadian Government Real Return Bond, 4.25%, 01/12/2026	3.423.689
60.445.000	Mexican Bonos, 7.75%, 29/05/2031	3.130.791
3.161.300	United States Treasury Note/Bond, 0.88%, 31/01/2024	3.040.981
4.033.410.000	Korea Treasury Bond, 2.13%, 10/06/2027	2.816.413
2.503.000	United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 31/01/2028	2.436.170
1.749.840	United Kingdom Inflation-Linked Gilt, 1.25%, 22/11/2032	2.415.414
2.465.000	United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/05/2033	2.362.083
2.330.000	United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/02/2033	2.322.107
2.054.000	United States Treasury Note/Bond, 0.50%, 31/03/2025	1.903.713
250.650.000	Japan Government Five Year Bond, 0.01%, 20/09/2026	1.698.799
1.505.000	Fannie Mae Pool, 6.00%, 01/03/2054	1.520.318
1.630.000	United States Treasury Note/Bond, 3.63%, 15/02/2053	1.517.698
1.490.000	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/08/2033	1.417.378
1.395.573	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0.25%, 15/02/2027	1.402.112
1.320.000	Bundesobligation, 2.40%, 19/10/2028	1.396.371
1.150.000	Mexico Government International Bond, 6.35%, 09/02/2035	1.185.038
1.145.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2054	1.161.758

Global Diversified Income FMP - 2024 – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
20.195.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024	19.866.577
5.200.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 21/12/2023	5.130.111
4.040.000	Ball Corp, 4.00%, 15/11/2023	3.989.500
3.000.000	HSBC Holdings Plc, 4.25%, 14/03/2024	2.954.520
3.000.000	Nationwide Building Society, 0.55%, 22/01/2024	2.898.840
3.000.000	Air Lease Corp, 0.70%, 15/02/2024	2.891.640
2.345.000	Sprint LLC, 7.13%, 15/06/2024	2.400.694
2.200.000	Energy Transfer LP, 3.90%, 15/05/2024	2.170.718
1.450.000	MGM China Holdings Ltd, 5.38%, 15/05/2024	1.430.813
815.000	NOVA Chemicals Corp, 4.88%, 01/06/2024	802.775
790.000	Taylor Morrison Communities Inc/Taylor Morrison Holdings II Inc, 5.63%, 01/03/2024	787.038
500.000	Shriram Finance Ltd, 4.40%, 13/03/2024	493.700
490.000	Ford Motor Credit Co LLC, 5.58%, 18/03/2024	486.938
480.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 5.13%, 15/05/2024	477.792
480.000	EQM Midstream Partners LP, 4.75%, 15/07/2023	477.600
470.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 5.25%, 15/04/2024	467.063
400.000	TRI Pointe Group Inc/TRI Pointe Homes Inc, 5.88%, 15/06/2024	399.500
400.000	Starwood Property Trust Inc, 5.50%, 01/11/2023	399.000
400.000	Hanesbrands Inc, 4.63%, 15/05/2024	394.900
390.000	OneMain Finance Corp, 6.13%, 15/03/2024	387.563

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
2.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 21/12/2023	1.976.977
1.385.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/01/2024	1.350.292
989.000	Egypt Government International Bond, 6.20%, 01/03/2024	908.958
800.000	REC Ltd, 3.50%, 12/12/2024	777.384
600.000	ABJA Investment Co Pte Ltd, 5.95%, 31/07/2024	598.620
400.000	Egypt Government International Bond, 4.55%, 20/11/2023	388.000
200.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.25%, 13/11/2024	186.400

Global Equity Megatrends – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
127.087	ModivCare Inc	5.610.039
247.528	Element Solutions Inc	4.635.045
55.745	Alibaba Group Holding Ltd ADR	4.584.254
170.383	Criteo SA ADR	4.528.475
112.847	Uber Technologies Inc	3.827.414
120.899	Perrigo Co Plc	3.766.792
41.428	Amdocs Ltd	3.679.875
168.904	Gen Digital Inc	3.335.826
99.034	Corning Inc	3.084.720
373.887	Zeta Global Holdings Corp Class A	3.020.088
60.798	Stericycle Inc	2.747.924
24.552	Expedia Group Inc	2.698.733
67.412	Scholastic Corp	2.505.049
598.469	Pets at Home Group Plc	2.450.236
11.826	Nice Ltd ADR	2.357.722
59.727	Delta Air Lines Inc	2.171.014
221.303	Despegar.com Corp	1.429.124
51.264	Vistra Corp	1.214.471
11.881	Alphabet Inc Class A	1.201.539
2.652	TE Connectivity Ltd	342.820

Global Equity Megatrends – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
16.228	Quanta Services Inc	3.096.215
9.013	Aon Plc Class A	2.791.492
204.763	Paya Holdings Inc	1.976.649
42.476	Vistra Corp	1.367.184
7.294	Expedia Group Inc	860.743
6.727	Alibaba Group Holding Ltd ADR	679.061
35.471	Element Fleet Management Corp	508.259
8.123	Uber Technologies Inc	413.271
9.941	ATI Inc	375.800
8.365	Scholastic Corp	348.301
2.371	Alphabet Inc Class A	277.216
9.059	Criteo SA ADR	251.642
2.495	Amdocs Ltd	223.005
43.067	Pets at Home Group Plc	191.972
1.204	TE Connectivity Ltd	153.714
3.948	Perrigo Co Plc	140.805
3.915	Corning Inc	135.746
13.256	Zeta Global Holdings Corp Class A	122.591
2.448	ModivCare Inc	114.716
5.488	Element Solutions Inc	104.863

Global Flexible Credit Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
8.410.000	United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/05/2033	8.168.903
5.080.000	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/05/2043	4.996.677
4.160.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029	4.067.595
3.740.000	Ford Motor Credit Co LLC, 7.20%, 10/06/2030	3.858.986
3.530.000	TransDigm Inc, 6.75%, 15/08/2028	3.582.244
3.516.000	Comstock Resources Inc, 6.75%, 01/03/2029	3.174.156
2.515.000	Bath & Body Works Inc, 6.63%, 01/10/2030	2.425.213
2.305.000	ZF North America Capital Inc, 7.13%, 14/04/2030	2.378.425
1.905.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 6.50%, 15/02/2028	1.910.081
1.795.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1B1, 7.94%, 25/07/2030	1.873.531
1.850.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6.75%, 15/04/2028	1.850.933
1.930.000	Iron Mountain Inc, 5.63%, 15/07/2032	1.770.775
1.930.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 5.00%, 01/02/2028	1.770.445
1.985.000	Macy's Retail Holdings LLC, 5.88%, 15/03/2030	1.764.006
1.775.000	American Airlines Inc, 7.25%, 15/02/2028	1.755.894
1.935.000	Energizer Holdings Inc, 4.75%, 15/06/2028	1.715.821
1.630.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026	1.628.988
1.630.000	HUB International Ltd, 7.25%, 15/06/2030	1.627.089
1.620.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 8.25%, 31/12/2028	1.611.587
1.585.000	Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 06/03/2026	1.586.325

Global Flexible Credit Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
8.410.000	United States Treasury Note/Bond, 3.38%, 15/05/2033	7.812.482
4.990.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026	4.916.890
4.210.000	Iron Mountain Inc, 5.63%, 15/07/2032	3.725.106
3.000.000	Trinitas CLO XII Ltd Series 2020-12X Class D, 8.36%, 25/04/2033	2.817.300
2.985.000	Ford Motor Credit Co LLC, 4.13%, 17/08/2027	2.749.616
3.350.000	Occidental Petroleum Corp, 4.30%, 15/08/2039	2.613.772
2.305.000	ZF North America Capital Inc, 7.13%, 14/04/2030	2.355.450
2.635.000	AssuredPartners Inc, 5.63%, 15/01/2029	2.304.000
2.600.000	WR Grace Holdings LLC, 5.63%, 15/08/2029	2.141.720
2.500.000	Petroleos Mexicanos, 6.50%, 23/01/2029	2.138.675
2.530.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4.25%, 01/02/2031	2.106.225
1.795.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities Class 1B1, 7.94%, 25/07/2030	1.913.919
2.000.000	Dryden 93 CLO Ltd Series 2021-93X Class D, 8.53%, 15/01/2034	1.846.000
2.335.000	Sirius XM Radio Inc, 3.88%, 01/09/2031	1.833.119
2.400.000	Buckeye Partners LP, 5.85%, 15/11/2043	1.790.607
1.960.000	SPX FLOW Inc, 8.75%, 01/04/2030	1.719.200
1.715.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp, 8.00%, 15/01/2027	1.690.873
2.030.000	CVS Health Corp, 5.05%, 25/03/2048	1.668.538
1.665.000	Harvest Midstream I LP, 7.50%, 01/09/2028	1.646.800
1.700.000	Sappi Papier Holding GmbH, 3.63%, 15/03/2028	1.635.390

Global SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
4.700.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029	4.453.139
3.970.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031	3.636.931
3.960.000	1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 4.00%, 15/10/2030	3.425.400
3.355.000	Windsor Holdings III LLC, 8.50%, 15/06/2030	3.378.413
3.200.000	Civitas Resources Inc, 8.63%, 01/11/2030	3.228.913
3.245.000	Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027	3.176.677
3.680.000	AthenaHealth Group Inc, 6.50%, 15/02/2030	3.145.098
3.050.000	GTCR W-2 Merger Sub LLC, 7.50%, 15/01/2031	3.050.786
3.280.000	Yum! Brands Inc, 3.63%, 15/03/2031	2.887.051
2.845.000	NCL Corp Ltd, 8.13%, 15/01/2029	2.860.346
2.820.000	Lorca Telecom Bondco SA, 4.00%, 18/09/2027	2.793.384
2.795.000	Aramark Services Inc, 5.00%, 01/02/2028	2.650.560
2.740.000	Molina Healthcare Inc, 4.38%, 15/06/2028	2.563.974
2.540.000	First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031	2.523.000
2.500.000	TransDigm Inc, 6.88%, 15/12/2030	2.508.293
2.330.000	ZF North America Capital Inc, 7.13%, 14/04/2030	2.384.739
2.395.000	IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026	2.340.810
2.305.000	HUB International Ltd, 7.25%, 15/06/2030	2.314.308
2.377.500	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026	2.309.185
2.155.000	Ritchie Bros Holdings Inc, 7.75%, 15/03/2031	2.232.882

Global SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
3.605.000	Iron Mountain Inc, 4.88%, 15/09/2027	3.333.767
2.955.000	IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026	2.866.670
2.771.000	LeasePlan Corp NV, 7.38%, 29/12/2049	2.830.236
2.765.000	Ford Motor Credit Co LLC, 4.69%, 09/06/2025	2.661.052
2.531.000	Adevinta ASA, 2.63%, 15/11/2025	2.618.747
3.110.000	CHS/Community Health Systems Inc, 6.00%, 15/01/2029	2.513.505
3.200.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4.50%, 01/06/2033	2.481.155
2.225.000	First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031	2.238.923
2.710.000	WR Grace Holdings LLC, 5.63%, 15/08/2029	2.197.567
2.225.000	EQM Midstream Partners LP, 6.50%, 01/07/2027	2.163.992
2.545.000	Yum! Brands Inc, 3.63%, 15/03/2031	2.155.825
2.175.000	TransDigm Inc, 6.25%, 15/03/2026	2.153.778
1.861.000	Marks & Spencer Plc, 3.75%, 19/05/2026	2.148.831
2.205.000	IQVIA Inc, 2.88%, 15/06/2028	2.140.589
2.180.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.75%, 20/04/2029	2.091.095
2.225.000	Aramark Services Inc, 5.00%, 01/02/2028	2.054.596
2.280.000	CAB SELAS, 3.38%, 01/02/2028	2.030.284
2.005.000	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp, 8.00%, 15/01/2027	1.963.249
1.830.000	Occidental Petroleum Corp, 6.45%, 15/09/2036	1.881.373
2.095.000	Sensata Technologies BV, 4.00%, 15/04/2029	1.846.698

Global High Yield Sustainable Action – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
190.000	IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026	184.465
135.000	Avient Corp, 7.13%, 01/08/2030	136.349
140.000	Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027	135.288
100.000	Belden Inc, 3.38%, 15/07/2027	98.331
100.000	eG Global Finance Plc, 4.38%, 07/02/2025	94.857
100.000	Heimstaden Bostad AB, 3.25%, 29/12/2049	82.561
75.000	Sprint Capital Corp, 6.88%, 15/11/2028	78.180
80.000	Clean Harbors Inc, 4.88%, 15/07/2027	76.600
80.000	Hologic Inc, 4.63%, 01/02/2028	76.401
75.000	Berry Global Inc, 5.63%, 15/07/2027	72.938
70.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026	70.150
60.000	TerraForm Power Operating LLC, 5.00%, 31/01/2028	56.586
55.000	NortonLifeLock Inc, 6.19%, 12/09/2029	54.931
50.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6.75%, 15/04/2028	50.000
45.000	Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 06/03/2026	45.043
45.000	Tenet Healthcare Corp, 6.75%, 15/05/2031	45.000
40.000	United Rentals North America Inc, 6.00%, 15/12/2029	40.200
40.000	Iron Mountain Inc, 5.25%, 15/03/2028	37.500
30.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 6.50%, 15/02/2028	30.000
30.000	United Rentals North America Inc, 5.50%, 15/05/2027	29.475
30.000	Clean Harbors Inc, 5.13%, 15/07/2029	28.950
30.000	CommScope Inc, 6.00%, 01/03/2026	28.875
30.000	EnerSys, 4.38%, 15/12/2027	28.125
30.000	CommScope Inc, 8.25%, 01/03/2027	26.475
25.000	Centene Corp, 4.25%, 15/12/2027	23.890
25.000	United Rentals North America Inc, 4.00%, 15/07/2030	22.202
25.000	APi Group DE Inc, 4.13%, 15/07/2029	21.656
20.000	Ford Motor Credit Co LLC, 8.04%, 06/03/2026	20.075
20.000	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 7.25%, 15/02/2028	20.000
25.000	Dana Inc, 4.50%, 15/02/2032	19.774
20.000	ZF North America Inc, 4.75%, 29/04/2025	19.550
20.000	Tenet Healthcare Corp, 4.88%, 01/01/2026	19.542

Global High Yield Sustainable Action – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
330.000	Iron Mountain Inc, 5.25%, 15/03/2028	309.375
265.000	IQVIA Inc, 5.00%, 15/10/2026	257.050
255.000	TerraForm Power Operating LLC, 5.00%, 31/01/2028	241.375
255.000	Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 6.25%, 15/01/2028	239.063
260.000	Frontier Communications Holdings LLC, 5.88%, 15/10/2027	237.019
240.000	Albertsons Cos Inc/Safeway Inc/New Albertsons LP/Albertsons LLC, 5.88%, 15/02/2028	234.022
270.000	OneMain Finance Corp, 3.50%, 15/01/2027	231.849
250.000	AssuredPartners Inc, 5.63%, 15/01/2029	216.130
220.000	Valvoline Inc, 4.25%, 15/02/2030	215.875
200.000	Belden Inc, 3.38%, 15/07/2027	203.178
205.000	Tenet Healthcare Corp, 4.88%, 01/01/2026	200.718
175.000	SGL Carbon SE, 4.63%, 30/09/2024	187.588
185.000	HCA Inc, 5.38%, 01/02/2025	184.375
220.000	Vmed O2 UK Financing I Plc, 4.75%, 15/07/2031	184.108
210.000	GYP Holdings III Corp, 4.63%, 01/05/2029	183.803
200.000	ZF Finance GmbH, 2.25%, 03/05/2028	183.295
200.000	Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 5.13%, 30/04/2031	171.250
170.000	APX Group Inc, 6.75%, 15/02/2027	167.300
175.000	NextEra Energy Operating Partners LP, 4.50%, 15/09/2027	164.339
200.000	VZ Secured Financing BV, 5.00%, 15/01/2032	163.262

Global Investment Grade Credit – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
1.240.000	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/05/2043	1.181.250
1.090.000	WEC Energy Group Inc, 4.75%, 09/01/2026	1.088.736
1.000.000	Daimler Truck Holding AG, 5.13%, 19/01/2028	999.350
900.000	Thames Water Utilities Finance Plc, 4.38%, 18/01/2031	917.785
875.000	United States Treasury Note/Bond, 3.75%, 15/04/2026	871.858
865.000	European Union, 0.00%, 04/07/2029	788.624
723.000	UBS Group AG, 3.25%, 02/04/2026	766.012
745.000	Morgan Stanley, 5.12%, 01/02/2029	744.985
655.000	Kenvue Inc, 5.00%, 22/03/2030	653.356
635.000	United States Treasury Note/Bond, 4.38%, 15/12/2026	639.415
600.000	Bayerische Landesbank, 7.00%, 05/01/2034	633.470
615.000	Amgen Inc, 5.15%, 02/03/2028	613.930
610.000	Intel Corp, 4.88%, 10/02/2028	609.494
605.000	Nationwide Building Society, 6.56%, 18/10/2027	605.000
540.000	Realty Income Corp, 5.13%, 06/07/2034	589.616
530.000	European Union, 0.80%, 04/07/2025	553.956
545.000	Enbridge Inc, 5.70%, 08/03/2033	546.752
500.000	A1 Towers Holding GmbH, 5.25%, 13/07/2028	540.533
540.000	Cox Communications Inc, 5.70%, 15/06/2033	540.232
535.000	Cooperatieve Rabobank UA, 5.50%, 18/07/2025	534.652

Global Investment Grade Credit – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
2.865.000	United States Treasury Note/Bond, 2.63%, 15/04/2025	2.778.854
1.240.000	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/05/2043	1.119.539
1.000.000	Daimler Truck Holding AG, 5.13%, 19/01/2028	1.001.590
1.000.000	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 4.50%, 15/09/2023	995.150
1.000.000	Bank of Montreal, 4.34%, 05/10/2028	990.375
1.000.000	Westpac Banking Corp, 2.89%, 04/02/2030	936.565
1.000.000	NatWest Group Plc, 3.07%, 22/05/2028	898.210
1.000.000	Vontier Corp, 1.80%, 01/04/2026	894.620
900.000	Anglo American Capital Plc, 3.63%, 11/09/2024	876.609
875.000	United States Treasury Note/Bond, 3.75%, 15/04/2026	862.727
850.000	Bank of America Corp, 1.95%, 27/10/2026	860.746
865.000	European Union, 0.00%, 04/07/2029	788.608
800.000	UBS Group AG, 1.01%, 30/07/2024	782.984
800.000	Berry Global Inc, 0.95%, 15/02/2024	774.866
800.000	Air Lease Corp, 0.70%, 15/02/2024	769.513
904.000	UBS Group AG, 0.65%, 14/01/2028	763.813
750.000	Diamondback Energy Inc, 6.25%, 15/03/2033	761.779
755.000	Baker Hughes Holdings LLC/Baker Hughes Co-Obligor Inc, 2.06%, 15/12/2026	679.523
700.000	Volkswagen International Finance NV, 3.88%, 29/12/2049	679.484
685.000	MPLX LP, 4.00%, 15/03/2028	645.695

Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
2.363.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 31/07/2024	2.314.363
1.883.000	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 31/03/2025	1.878.446
1.776.000	United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 31/01/2025	1.773.370
29.200.000	Mexican Bonos, 7.50%, 26/05/2033	1.502.098
18.973.000.000	Indonesia Treasury Bond, 7.00%, 15/02/2033	1.274.961
1.190.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2054	1.207.071
1.220.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2054	1.193.998
1.110.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/06/2054	1.114.734
911.000	United Kingdom Gilt, 3.25%, 31/01/2033	1.106.990
7.850.000	China Government Bond, 2.62%, 25/06/2030	1.081.690
7.100.000	China Government Bond, 2.88%, 25/02/2033	1.033.856
995.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2054	1.002.996
1.050.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/02/2053	992.127
860.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2054	871.740
870.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2054	870.102
867.000	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 30/06/2028	868.324
729.000	European Union, 3.25%, 04/07/2034	824.581
795.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/03/2043	791.913
795.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054	790.770
798.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 30/06/2024	781.575

Global Opportunistic Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
3.433.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 31/07/2024	3.356.504
1.883.000	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 31/03/2025	1.863.690
1.776.000	United States Treasury Note/Bond, 4.13%, 31/01/2025	1.756.043
200.000	Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund	1.724.000
10.180.000	China Government Bond, 2.56%, 21/10/2023	1.512.738
1.190.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2054	1.207.768
1.220.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2054	1.204.947
1.190.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/02/2054	1.203.596
1.240.000	United States Treasury Note/Bond, 3.25%, 30/06/2027	1.203.529
1.110.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/06/2054	1.114.734
911.000	United Kingdom Gilt, 3.25%, 31/01/2033	1.047.024
1.050.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/02/2053	1.020.540
995.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/03/2054	990.425
870.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/01/2054	870.374
860.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/05/2054	868.539
870.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2054	867.446
867.000	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 30/06/2028	855.829
5.490.000	China Government Bond, 2.26%, 24/02/2025	810.053
795.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/04/2054	806.424
1.326.000	New Zealand Government Bond, 3.50%, 14/04/2033	791.168

Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
1.296	Equinix Inc	969.764
382	Nippon Prologis REIT Inc	879.165
762	GLP J-REIT	867.146
33.800	Nomura Real Estate Holdings Inc	740.164
215.869	Grainger Plc	674.628
568.000	Sino Land Co Ltd	659.827
20.511	VICI Properties Inc Class A	655.195
2.049	Public Storage	577.885
39.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	536.577
59.786	Merlin Properties Socimi SA	535.903
312.052	Region RE Ltd	525.819
10.958	Shurgard Self Storage Ltd	496.808
7.547	Realty Income Corp	477.038
69.545	Hudson Pacific Properties Inc	433.544
93	Nippon Building Fund Inc	385.982
130.720	GPT Group	382.885
2.211	EastGroup Properties Inc	358.568
1.901	American Tower Corp	353.250
2.470	Crown Castle Inc	317.474
2.811	Simon Property Group Inc	309.825
10.184	Weyerhaeuser Co	298.572
9.004	Omega Healthcare Investors Inc	286.888
14.402	Kimco Realty Corp	280.613
7.426	Canadian Apartment Properties REIT	272.016
1.564	AvalonBay Communities Inc	270.414
3.416	Unibail-Rodamco-Westfield	258.077
15.109	RioCan Real Estate Investment Trust	247.472
1.849	Sun Communities Inc	238.762
4.283	Boston Properties Inc	233.238
3.487	Equity LifeStyle Properties Inc	228.368
1.890	PSP Swiss Property AG	224.805
2.436	Swiss Prime Site AG	223.873
879	SBA Communications Corp Class A	218.286
14.329	Urban Edge Properties	215.474
23.690	Tricon Residential Inc	202.665
3.893	Iron Mountain Inc	201.606
31.600	Link REIT	199.972

Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
12.119	Prologis Inc	1.417.216
5.961	American Tower Corp	1.146.374
3.904	Public Storage	1.072.659
1.421	Equinix Inc	1.062.033
42.200	Mitsui Fudosan Co Ltd	917.513
246	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc	915.095
11.400	Welltower Inc	904.276
50.173	Summit Industrial Income REIT	868.371
762	GLP J-REIT	867.092
65.900	Mitsubishi Estate Co Ltd	790.819
20.209	Cellnex Telecom SA	777.207
7.790	Digital Realty Trust Inc	740.763
6.658	Crown Castle Inc	724.535
12.963	Realty Income Corp	700.685
144.000	China Resources Land Ltd	694.462
69.225	Segro Plc	674.118
57.000	Sun Hung Kai Properties Ltd	663.522
60.156	Safestore Holdings Plc	635.563
10.508	Iron Mountain Inc	634.341
113.500	CK Asset Holdings Ltd	618.624
25.200	Nomura Real Estate Holdings Inc	585.091
122.500	UOL Group Ltd	573.724
28.847	Kimco Realty Corp	568.800
18.023	VICI Properties Inc Class A	536.557
15.643	Invitation Homes Inc	518.416
343.636	Region RE Ltd	499.352
4.132	Simon Property Group Inc	490.581
41.436	UNITE Group Plc	475.184
79.000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	462.690
3.636	Sun Communities Inc	461.738
6.723	Equity LifeStyle Properties Inc	446.856
78.273	Great Portland Estates Plc	440.113
10.648	UDR Inc	434.700
1.959	Essex Property Trust Inc	429.812
10.872	Spirit Realty Capital Inc	427.847
55.841	Land Securities Group Plc	418.797
6.924	Equity Residential	409.875
390	LaSalle Logiport REIT	407.505
29.647	RioCan Real Estate Investment Trust	407.143
3.133	Extra Space Storage Inc	403.270
20.426	Healthpeak Properties Inc	402.782
8.712	Ventas Inc	396.104

Global Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
12.422	Weyerhaeuser Co	388.018
10.971	American Homes 4 Rent Class A	385.597
3.582	Gecina SA	384.641
6.245	Boston Properties Inc	360.164

Global Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
10.237	Synopsys Inc	3.925.844
38.518	Starbucks Corp	3.924.307
18.388	Schneider Electric SE	3.279.923
9.415	Microsoft Corp	2.699.319
6.024	L'Oreal SA	2.513.907
19.910	Nestle SA	2.363.253
14.737	SolarEdge Technologies Inc	2.172.628
2.006	Adyen NV	2.009.655
10.092	Estee Lauder Cos Inc Class A	1.939.726
3.759	UnitedHealth Group Inc	1.865.063
24.467	Alfen NV	1.777.136
3.574	VAT Group AG	1.149.278
6.931	Straumann Holding AG	926.718
5.205	Zoetis Inc Class A	895.219
7.585	NIKE Inc Class B	837.865
23.500	Recruit Holdings Co Ltd	785.558
9.822	Bakkafrost P/F	606.006
1.114	Thermo Fisher Scientific Inc	603.220
1.453	Adobe Inc	581.320
2.339	Visa Inc Class A	579.033
1.409	Mastercard Inc Class A	561.006
4.401	Amazon.com Inc	516.423
22.510	Assa Abloy AB Class B	511.030
3.997	Alphabet Inc Class A	453.829
1.161	Netflix Inc	445.908
4.219	Abbott Laboratories	444.995
896	Elevance Health Inc	432.111

Global Sustainable Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
5.872	Adobe Inc	3.041.013
23.550	Amazon.com Inc	3.013.803
21.773	Alphabet Inc Class A	2.698.648
7.386	S&P Global Inc	2.569.456
113.699	3i Group Plc	2.559.115
2.054	Adyen NV	2.501.000
4.292	UnitedHealth Group Inc	2.282.312
4.318	Synopsys Inc	2.118.699
12.719	Marsh & McLennan Cos Inc	1.995.110
6.062	Microsoft Corp	1.994.391
16.014	Applied Materials Inc	1.942.814
5.474	Moody's Corp	1.719.121
100.384	TeamViewer SE	1.650.905
3.013	Intuit Inc	1.619.135
48.018	Match Group Inc	1.520.248
22.234	Brown & Brown Inc	1.340.494
3.101	Netflix Inc	1.155.900
71.862	Atlas Copco AB Class A	1.095.433
15.836	Alfen NV	1.076.600
15.775	Nasdaq Inc	852.060
1.662	Thermo Fisher Scientific Inc	850.891
3.455	Nordson Corp	806.312
1.086	ASML Holding NV	755.052
23.720	HelloFresh SE	745.349
544	Partners Group Holding AG	622.168
5.681	Novo Nordisk A/S Class B	552.333
2.240	Danaher Corp	519.900
4.243	NIKE Inc Class B	511.435

Global Sustainable Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
31.777	Shell Plc	941.783
2.963	Caterpillar Inc	792.813
2.501	Home Depot Inc	781.994
52.066	Iberdrola SA	671.018
9.309	Hartford Financial Services Group Inc	665.162
4.431	Ferguson Plc	655.772
5.331	Simon Property Group Inc	612.074
9.549	Occidental Petroleum Corp	581.855
5.338	Merck & Co Inc	580.823
7.888	PulteGroup Inc	577.369
4.667	Expeditors International of Washington Inc	538.410
13.573	Comcast Corp Class A	537.319
7.821	TotalEnergies SE	476.748
14.938	Fox Corp Class B	463.253
14.370	CSX Corp	459.580
2.744	Johnson & Johnson	453.590
1.990	Meta Platforms Inc Class A	447.516
512	Broadcom Inc	444.318
22.569	Manulife Financial Corp	437.628
813	Humana Inc	404.569

Global Sustainable Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
5.120	Marathon Petroleum Corp	748.193
42.874	AT&T Inc	637.508
9.946	Bristol-Myers Squibb Co	623.887
4.767	Valero Energy Corp	599.851
1.663	Goldman Sachs Group Inc	546.268
8.224	ONEOK Inc	543.222
2.945	Apple Inc	541.221
5.437	Phillips 66	525.627
14.370	Anglo American Plc	498.596
1.661	Meta Platforms Inc Class A	490.135
15.483	Pembina Pipeline Corp	488.764
941	UnitedHealth Group Inc	482.671
2.767	Cheniere Energy Inc	472.975
1.617	Microsoft Corp	460.145
12.131	Enbridge Inc	457.088
8.907	CRH Plc	439.316
975	United Rentals Inc	432.718
6.314	General Mills Inc	424.620
53.489	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	415.165
3.163	Alphabet Inc Class A	405.973

High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
41.090.000	United States Treasury Note/Bond, 5.00%, 31/08/2025	40.949.148
16.610.000	TransDigm Inc, 6.75%, 15/08/2028	16.741.731
16.110.000	First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031	16.005.675
14.540.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026	14.559.843
14.275.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 10.50%, 15/02/2028	14.283.163
13.730.000	HUB International Ltd, 7.25%, 15/06/2030	13.741.224
13.660.000	EquipmentShare.com Inc, 9.00%, 15/05/2028	13.172.054
12.660.000	Ritchie Bros Holdings Inc, 7.75%, 15/03/2031	12.975.096
12.965.000	Regal Rexnord Corp, 6.40%, 15/04/2033	12.873.866
12.165.000	Civitas Resources Inc, 8.63%, 01/11/2030	12.198.925
11.075.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 9.25%, 15/04/2027	10.469.485
10.055.000	Tenet Healthcare Corp, 6.75%, 15/05/2031	10.052.078
10.220.000	Pilgrim's Pride Corp, 6.25%, 01/07/2033	10.040.402
11.455.000	AthenaHealth Group Inc, 6.50%, 15/02/2030	9.878.354
11.150.000	Caesars Entertainment Inc, 4.63%, 15/10/2029	9.753.413
9.710.000	Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 06/03/2026	9.718.100
9.655.000	Churchill Downs Inc, 6.75%, 01/05/2031	9.655.000
10.790.000	CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC, 5.50%, 15/06/2031	9.515.184
8.720.000	NRG Energy Inc, 10.25%, 29/12/2049	8.780.471
8.765.000	Petco Animal Supplies Inc, 0.00%, 03/03/2028	8.740.386

High Yield Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
21.780.000	OneMain Finance Corp, 3.50%, 15/01/2027	18.526.100
20.615.000	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6.50%, 15/09/2024	18.438.058
19.565.000	MPH Acquisition Holdings LLC, 5.75%, 01/11/2028	13.791.774
21.825.000	Level 3 Financing Inc, 4.63%, 15/09/2027	13.479.925
13.405.417	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026	13.095.723
12.460.000	First Quantum Minerals Ltd, 8.63%, 01/06/2031	12.550.838
14.420.000	Medline Borrower LP, 5.25%, 01/10/2029	12.105.286
11.745.000	Occidental Petroleum Corp, 6.13%, 01/01/2031	11.913.050
23.200.000	CSC Holdings LLC, 5.75%, 15/01/2030	11.860.105
15.931.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5.75%, 15/01/2029	11.625.321
11.300.000	Harvest Midstream I LP, 7.50%, 01/09/2028	11.059.510
12.010.000	Sirius XM Radio Inc, 5.00%, 01/08/2027	11.052.794
10.765.000	Regal Rexnord Corp, 6.40%, 15/04/2033	10.735.554
15.109.000	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5.25%, 15/04/2030	10.363.409
11.130.000	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6.75%, 15/10/2027	10.355.631
9.190.000	Occidental Petroleum Corp, 7.50%, 01/05/2031	10.102.527
10.460.000	Presidio Holdings Inc, 8.25%, 01/02/2028	9.950.727
11.030.000	Ardagh Packaging Finance Plc/Ardagh Holdings USA Inc, 4.13%, 15/08/2026	9.839.756
9.710.000	Ford Motor Credit Co LLC, 6.95%, 06/03/2026	9.785.475
11.150.000	Caesars Entertainment Inc, 4.63%, 15/10/2029	9.626.864

InnovAsia 5G – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
62.000	Novatek Microelectronics Corp	924.830
8.200	Socionext Inc	853.774
8.300	Shibaura Mechatronics Corp	842.841
39.400	Mercari Inc	841.511
10.900	Rohm Co Ltd	743.867
10.200	Enplas Corp	721.709
13.165	HAESUNG DS Co Ltd	696.907
122.000	Unimicron Technology Corp	691.647
147.200	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co Ltd Class A	570.442
167.000	Gold Circuit Electronics Ltd	553.086
165.000	Lite-On Technology Corp	543.953
8.444	Polycab India Ltd	542.678
17.000	JMDC Inc	541.829
17.800	Harmonic Drive Systems Inc	530.622
27.650	Baidu Inc Class A	516.805
70.330	Shenzhen Sinexcel Electric Co Ltd Class A	512.458
6.188	JYP Entertainment Corp	500.266
43.141	Bharti Airtel Ltd	476.373
16.900	Nitto Boseki Co Ltd	460.908
73.000	E Ink Holdings Inc	456.533
561.649	Zomato Ltd	443.256
124.400	Longshine Technology Group Co Ltd Class A	438.288
38.900	Sansan Inc	431.010
800	SMC Corp	430.293
274.000	KCE Electronics PCL	425.450
26.000	Jentech Precision Industrial Co Ltd	424.950
5.485	SK Hynix Inc	422.308
105.000	Taiwan Union Technology Corp	420.581
135.000	Vanguard International Semiconductor Corp	411.633
272.000	Inventec Corp	402.065
95.000	Tripod Technology Corp	396.856
8.700	Square Enix Holdings Co Ltd	391.852
261.000	United Microelectronics Corp	389.624
31.000	ASUSTeK Computer Inc	373.606
6.000	Global Unichip Corp	350.061
118.000	Wistron Corp	349.620
29.000	Faraday Technology Corp	349.389
315.000	Compal Electronics Inc	343.240
14.157	Hanmi Semiconductor Co Ltd	339.922
14.000	WinWay Technology Co Ltd	330.765
54.000	Win Semiconductors Corp	327.942
2.338	LEENO Industrial Inc	326.024
38.951	One 97 Communications Ltd	325.761
15.243	Kanzhun Ltd ADR	324.331

InnovAsia 5G – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
1.563	LG Innotek Co Ltd	318.160
187.600	Hana Microelectronics PCL	317.570
22.442	Tech Mahindra Ltd	317.316
5.000	eMemory Technology Inc	306.957
10.000	Parade Technologies Ltd	300.425
5.757	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	299.091
13.609	HPSP Co Ltd	286.577
2.374	Fabrinet	283.288
13.300	Meituan Class B	278.258

InnovAsia 5G – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
13.900	Socionext Inc	1.692.150
194.000	Unimicron Technology Corp	1.038.775
167.000	Gold Circuit Electronics Ltd	926.757
136.000	E Ink Holdings Inc	768.247
11.382	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	659.528
17.600	Square Enix Holdings Co Ltd	652.122
165.000	Lite-On Technology Corp	645.923
10.817	Rambus Inc	640.086
50.500	Sansan Inc	617.939
211.200	Longshine Technology Group Co Ltd Class A	602.195
35.000	Yageo Corp	590.522
95.000	Tripod Technology Corp	550.061
272.000	Inventec Corp	541.054
8.000	eMemory Technology Inc	506.192
9.849	Beijing Kingsoft Office Software Inc Class A	491.007
103.000	Hongfa Technology Co Ltd Class A	467.804
36.000	Silergy Corp	453.814
33.000	Accton Technology Corp	434.194
27.650	Baidu Inc Class A	429.820
15.851	Beijing Huafeng Test & Control Technology Co Ltd Class A	427.523
22.800	Meituan Class B	426.012
104.700	Zhejiang Jiemei Electronic & Technology Co Ltd Class A	422.650
48.800	CyberAgent Inc	419.078
2.246	LG Innotek Co Ltd	413.976
261.000	United Microelectronics Corp	411.592
21.000	Jentech Precision Industrial Co Ltd	404.046
135.000	Vanguard International Semiconductor Corp	393.762
9.900	JMDC Inc	359.053
2.400	Shibaura Mechatronics Corp	347.333
55.000	Elite Material Co Ltd	342.317
31.000	ASUSTeK Computer Inc	333.128
1.400	Disco Corp	326.673
54.000	Win Semiconductors Corp	303.454
38.951	One 97 Communications Ltd	302.880
6.700	Hamamatsu Photonics KK	299.261
10.000	Parade Technologies Ltd	296.429
46.000	Chroma ATE Inc	289.971
315.000	Compal Electronics Inc	285.239
30.150	Zhejiang Jingsheng Mechanical & Electrical Co Ltd Class A	283.174
17.409	Kanzhun Ltd ADR	278.253
20.000	Novatek Microelectronics Corp	276.416
13.200	Dexerials Corp	267.552
1.655	Fabrinet	266.875
6.400	Rohm Co Ltd	252.457
14.600	Furukawa Electric Co Ltd	241.549

Japan Equity Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten JPY
257.200	FP Partner Inc	1.103.442.435
129.000	JSB Co Ltd	612.071.844
501.700	Ricoh Co Ltd	575.956.575
353.000	Amada Co Ltd	521.878.485
193.000	Kosaido Holdings Co Ltd	486.611.522
186.000	Daiei Kankyo Co Ltd	395.607.462
43.000	Osaka Soda Co Ltd	376.224.041
360.100	TRYT Inc	372.524.347
52.000	Tokyo Seimitsu Co Ltd	368.553.962
63.000	Keisei Electric Railway Co Ltd	364.716.800
66.000	Zenkoku Hosho Co Ltd	344.790.254
98.000	Asics Corp	342.360.783
133.000	TBS Holdings Inc	325.152.885
166.500	Transaction Co Ltd	286.861.480
135.600	Kansai Paint Co Ltd	283.682.120
195.000	Yamanashi Chuo Bank Ltd	281.807.336
57.000	San-A Co Ltd	268.518.297
32.000	ABC-Mart Inc	254.399.313
68.400	St Cousair Co Ltd	230.426.291
102.100	Pasona Group Inc	222.877.022
121.700	Genda Inc	221.917.800
73.000	Okinawa Cellular Telephone Co	219.955.163
99.000	Open Up Group Inc	214.688.510
103.000	Menicon Co Ltd	202.150.003
25.700	M&A Research Institute Holdings Inc	192.500.241
134.000	Skymark Airlines Inc	186.306.620
50.000	Inforich Inc	181.639.385
25.000	Macnica Holdings Inc	181.086.959
23.000	Visional Inc	175.456.815
64.000	USS Co Ltd	165.835.055
52.000	MEC Co Ltd	164.813.936
29.800	Fujimi Inc	157.687.102
202.000	Cover Corp	154.322.200
36.000	Nifco Inc	149.284.846
37.000	Tokyotokeiba Co Ltd	146.891.922
52.000	TKP Corp	140.782.468
52.300	Nareru Group Inc	138.579.372

Japan Equity Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse JPY
1.076.700	Ricoh Co Ltd	1.202.481.400
563.000	Amada Co Ltd	801.429.317
170.200	FP Partner Inc	748.138.473
890.000	Tokyu Fudosan Holdings Corp	720.897.312
136.000	Zenkoku Hosho Co Ltd	674.775.924
213.000	Okinawa Cellular Telephone Co	660.825.824
280.000	Shoei Co Ltd	637.013.553
126.000	Yamaha Corp	559.181.117
113.400	Pilot Corp	534.241.849
275.000	Open Up Group Inc	527.352.009
303.800	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	502.877.189
198.500	Cover Corp	427.851.302
155.000	USS Co Ltd	398.853.253
96.000	Nifco Inc	363.255.699
270.000	Daiwa Industries Ltd	362.821.183
109.000	JSB Co Ltd	346.859.710
109.000	Nakanishi Inc	301.220.905
101.000	Niterra Co Ltd	299.413.023
142.000	Kosaido Holdings Co Ltd	296.464.313
60.000	Hokkoku Financial Holdings Inc	295.018.816
79.000	Zuken Inc	289.566.329
140.600	Kansai Paint Co Ltd	287.487.882
72.000	Daiseki Co Ltd	286.370.456
244.500	Direct Marketing MiX Inc	276.089.386
106.000	Yokogawa Electric Corp	266.311.983
72.000	JSR Corp	265.060.920
88.000	BML Inc	262.116.090
123.000	Resorttrust Inc	260.785.916
153.000	Appier Group Inc	258.463.274
126.000	Comture Corp	257.948.226
80.000	St Cousair Co Ltd	252.126.974
118.000	Daiei Kankyo Co Ltd	240.836.620
500.000	Concordia Financial Group Ltd	240.381.175
110.700	Genda Inc	229.008.372
41.000	SHO-BOND Holdings Co Ltd	221.959.817
43.900	As One Corp	216.117.914
67.000	Fujimi Inc	212.201.390
115.000	Yamanashi Chuo Bank Ltd	211.072.449

Macro Opportunities FX – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
3.300.000	Finland T-Bill, 0.00%, 13/02/2024	3.223.736
2.300.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 12/06/2024	2.221.796
1.900.000	German Treasury Bill, 0.00%, 15/05/2024	1.847.393
1.700.000	Finland T-Bill, 0.00%, 14/05/2024	1.656.763
1.500.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 3.60%, 08/03/2024	1.498.110
1.500.000	Royal Bank of Canada, 0.25%, 29/01/2024	1.458.395
1.500.000	BNZ International Funding Ltd, 0.50%, 03/07/2024	1.454.970
1.500.000	Santander UK Plc, 0.10%, 12/05/2024	1.451.985
1.500.000	German Treasury Bill, 0.00%, 19/06/2024	1.448.903
1.400.000	BPCE SFH SA, 0.38%, 21/02/2024	1.358.560
1.350.000	ESM T-Bill, 0.00%, 20/07/2023	1.332.511
1.350.000	Toronto-Dominion Bank, 0.50%, 03/04/2024	1.315.020
1.300.000	ESM T-Bill, 0.00%, 23/11/2023	1.280.206
1.300.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.25%, 23/02/2024	1.280.123
1.000.000	La Banque Postale Home Loan SFH SA, 2.38%, 15/01/2024	991.330
1.000.000	Bank of Montreal, 0.25%, 10/01/2024	980.880
1.000.000	DNB Boligkreditt AS, 0.38%, 14/11/2023	980.250
1.000.000	Finland T-Bill, 0.00%, 13/11/2023	977.405
1.000.000	Westpac Securities NZ Ltd, 0.50%, 17/01/2024	974.850
1.000.000	Dexia Credit Local SA, 0.63%, 03/02/2024	974.170
1.000.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.25%, 30/04/2024	970.740
850.000	Finland T-Bill, 0.00%, 12/04/2023	845.714
800.000	European Union Bill, 0.00%, 10/11/2023	788.112
600.000	Societe Generale SFH SA, 2.00%, 29/04/2024	591.834
500.000	Caisse Centrale du Credit Immobilier de France SA, 0.00%, 17/01/2024	484.915
450.000	German Treasury Bill, 0.00%, 17/04/2024	443.158
400.000	Finland T-Bill, 0.00%, 13/03/2024	395.239

Macro Opportunities FX – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
3.300.000	Finland T-Bill, 0.00%, 13/02/2024	3.246.654
3.250.000	Finland T-Bill, 0.00%, 14/08/2023	3.231.699
1.900.000	German Treasury Bill, 0.00%, 15/05/2024	1.855.074
1.750.000	France Treasury Bill BTF, 0.00%, 12/06/2024	1.710.902
1.500.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 3.60%, 08/03/2024	1.497.848
1.500.000	Cie de Financement Foncier SA, 0.33%, 12/09/2023	1.495.035
1.500.000	Commerzbank AG, 0.25%, 13/09/2023	1.491.870
1.500.000	DNB Boligkreditt AS, 0.38%, 14/11/2023	1.489.729
1.500.000	Bank of Nova Scotia, 0.38%, 23/10/2023	1.489.200
1.500.000	Santander UK Plc, 0.38%, 20/09/2023	1.486.890
1.500.000	Royal Bank of Canada, 0.25%, 29/01/2024	1.482.549
1.500.000	Santander UK Plc, 0.10%, 12/05/2024	1.464.960
1.500.000	BNZ International Funding Ltd, 0.50%, 03/07/2024	1.460.786
1.400.000	BPCE SFH SA, 0.38%, 21/02/2024	1.381.425
1.350.000	ESM T-Bill, 0.00%, 20/07/2023	1.344.886
1.350.000	Toronto-Dominion Bank, 0.50%, 03/04/2024	1.326.728
1.300.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.25%, 23/02/2024	1.282.242
1.300.000	ESM T-Bill, 0.00%, 23/11/2023	1.282.028
1.200.000	Belfius Bank SA, 0.38%, 24/10/2023	1.196.232
1.200.000	ESM T-Bill, 0.00%, 20/04/2023	1.193.464
1.050.000	Finland T-Bill, 0.00%, 14/05/2024	1.026.720
1.000.000	Caisse de Refinancement de l'Habitat SA, 3.90%, 20/10/2023	1.000.690
1.000.000	UNEDIC ASSEO, 2.25%, 05/04/2023	999.800
1.000.000	Arkea Home Loans SFH SA, 2.38%, 11/07/2023	999.210
1.000.000	National Bank of Canada, 0.00%, 29/09/2023	998.840
1.000.000	AXA Bank Europe SCF, 0.38%, 23/03/2023	998.480
1.000.000	BNG Bank NV, 0.05%, 11/07/2023	998.372
1.000.000	Jyske Realkredit A/S, 0.25%, 01/07/2023	998.210
1.000.000	DNB Boligkreditt AS, 0.25%, 18/04/2023	996.690
1.000.000	La Banque Postale Home Loan SFH SA, 2.38%, 15/01/2024	995.705
1.000.000	OP Mortgage Bank, 0.25%, 11/05/2023	995.384
1.000.000	Dexia Credit Local SA, 0.25%, 01/06/2023	993.920
1.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0.13%, 07/06/2023	992.540
1.000.000	BPCE SFH SA, 2.38%, 29/11/2023	992.240
1.000.000	Westpac Securities NZ Ltd, 0.50%, 17/01/2024	990.983
1.000.000	Bank of Montreal, 0.25%, 10/01/2024	990.342
1.000.000	Dexia Credit Local SA, 0.63%, 03/02/2024	989.484
1.000.000	Finland T-Bill, 0.00%, 13/11/2023	987.896
1.010.000	German Treasury Bill, 0.00%, 19/06/2024	982.239
1.000.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.25%, 30/04/2024	980.199
900.000	Societe Generale SFH SA, 0.25%, 11/09/2023	898.326
850.000	Finland T-Bill, 0.00%, 12/04/2023	847.976
800.000	Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV, 0.13%, 01/06/2023	794.664
800.000	European Union Bill, 0.00%, 10/11/2023	789.972
600.000	ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0.13%, 22/09/2023	599.916

Multi-Asset Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
2.745	iShares J.P. Morgan $ EM Bond UCITS ETF	237.756
100.000	Benteler International Aktiengesellschaft, 9.38%, 15/05/2028	109.387
100.000	Ford Motor Credit Co LLC, 4.87%, 03/08/2027	106.318
100.000	Abertis Infraestructuras Finance BV, 3.25%, 29/12/2049	98.567
100.000	eG Global Finance Plc, 4.38%, 07/02/2025	94.857
80.000	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/11/2052	84.149
80.000	United States Treasury Note/Bond, 3.00%, 15/11/2044	70.118
65.000	United States Treasury Note/Bond, 3.13%, 15/05/2048	58.028
65.000	United States Treasury Note/Bond, 2.38%, 15/05/2051	49.686
65.000	United States Treasury Note/Bond, 2.00%, 15/11/2041	49.249
62.000	Capital One Financial Corp, 3.95%, 29/12/2049	47.591
35.000	Citigroup Inc, 7.38%, 29/12/2049	35.000
35.000	Truist Financial Corp, 5.10%, 29/12/2049	31.161
30.000	United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/02/2033	30.245
30.000	United States Treasury Note/Bond, 3.88%, 15/02/2043	29.594
35.000	United States Treasury Note/Bond, 2.50%, 15/02/2045	28.341
900	New Fortress Energy Inc Class A	27.223
3.599	iShares MSCI India UCITS ETF	25.879
246	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	21.747
30.000	United States Treasury Note/Bond, 2.00%, 15/08/2051	21.340

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
40.890	Neuberger Berman China Bond Fund	407.674
2.745	iShares J.P. Morgan $ EM Bond UCITS ETF	231.944
16.300	Neuberger Berman Commodities Fund	177.881
210.000	NatWest Group Plc, 4.60%, 29/12/2049	150.413
200.000	ING Groep NV, 3.88%, 29/12/2049	142.078
100.000	NGG Finance Plc, 5.63%, 18/06/2073	120.453
100.000	Benteler International Aktiengesellschaft, 9.38%, 15/05/2028	111.905
120.000	Petroleos Mexicanos, 4.75%, 26/02/2029	109.963
100.000	Assemblin Financing, 8.53%, 15/05/2025	108.861
100.000	Ford Motor Credit Co LLC, 4.87%, 03/08/2027	107.962
1.500	Targa Resources Corp	105.591
100.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, 2.00%, 15/07/2025	104.146
100.000	Electricite de France SA, 5.88%, 29/12/2049	103.884
100.000	Electricite de France SA, 5.00%, 29/12/2049	103.689
100.000	eG Global Finance Plc, 3.63%, 07/02/2024	102.784
100.000	eG Global Finance Plc, 4.38%, 07/02/2025	102.704
100.000	INEOS Finance Plc, 2.88%, 01/05/2026	102.396
100.000	Gruenenthal GmbH, 4.13%, 15/05/2028	102.115
100.000	Bayer AG, 5.38%, 25/03/2082	101.745
100.000	Telefonica Europe BV, 3.88%, 29/12/2049	101.243

Next Generation Mobility – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
62.393	MP Materials Corp	1.254.022
37.000	BYD Co Ltd - H Shares	1.132.744
2.602	Deere & Co	931.852
4.498	Autodesk Inc	880.196
4.712	Verisk Analytics Inc Class A	852.868
1.839	LG Chem Ltd	815.437
2.068	LG Energy Solution Ltd	796.514
4.135	Albemarle Corp	783.349
3.189	Caterpillar Inc	727.813
4.502	T-Mobile US Inc	615.818
3.624	Analog Devices Inc	591.034
8.839	Micron Technology Inc	533.272
6.509	Ambarella Inc	468.631
2.773	Schneider Electric SE	457.745
1.883	Cadence Design Systems Inc	426.540
3.823	Amazon.com Inc	411.451
5.670	ON Semiconductor Corp	410.785
969	Monolithic Power Systems Inc	387.314
4.205	Amphenol Corp Class A	327.371
2.042	Keysight Technologies Inc	326.073
1.156	Air Products & Chemicals Inc	321.286
2.307	Tesla Inc	313.984
6.264	Rambus Inc	303.790
1.589	NXP Semiconductors NV	274.511
525	Linde Plc	171.074
967	Texas Instruments Inc	170.709
1.456	Applied Materials Inc	167.242
13.999	ChargePoint Holdings Inc	167.134
3.498	Trimble Inc	166.992
267	ASML Holding NV	164.680

Next Generation Mobility – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
11.375	ANSYS Inc	3.664.560
18.069	Analog Devices Inc	3.282.116
55.646	Rambus Inc	3.016.657
7.395	NVIDIA Corp	2.785.826
14.433	Amazon.com Inc	1.755.119
19.543	Lattice Semiconductor Corp	1.721.228
18.480	Amphenol Corp Class A	1.582.482
10.622	Applied Materials Inc	1.506.735
9.385	Keysight Technologies Inc	1.469.400
3.662	Deere & Co	1.434.945
5.975	Cadence Design Systems Inc	1.370.991
6.734	Autodesk Inc	1.361.951
40.768	Gentex Corp	1.231.089
5.026	Caterpillar Inc	1.212.095
2.003	Monolithic Power Systems Inc	1.056.973
18.242	Magna International Inc	1.006.410
34.213	MP Materials Corp	968.077
9.581	Alphabet Inc Class A	880.131
4.236	Schneider Electric SE	742.792
7.054	BE Semiconductor Industries NV	742.222
17.741	Uber Technologies Inc	727.549
4.797	T-Mobile US Inc	698.956
19.404	General Motors Co	662.009
8.349	Ambarella Inc	660.894
2.257	Air Products & Chemicals Inc	656.079
1.695	Linde Plc	637.441
5.029	Advanced Micro Devices Inc	612.305
4.260	TE Connectivity Ltd	582.117
7.349	ON Semiconductor Corp	560.228
1.954	Tesla Inc	516.192
3.557	Zscaler Inc	492.822
7.187	Altair Engineering Inc Class A	490.761
56.386	NIO Inc ADR	480.188

Next Generation Space Economy – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
3.554	Boeing Co	741.238
116.298	Rocket Lab USA Inc	536.326
10.133	Iridium Communications Inc	522.228
4.816	NV5 Global Inc	485.081
8.226	Intellian Technologies Inc	466.409
204.682	Spirent Communications Plc	461.182
878	Lockheed Martin Corp	406.498
985	Teledyne Technologies Inc	394.260
2.475	Safran SA	372.270
8.800	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	370.789
2.434	Keysight Technologies Inc	348.507
10.331	AXA SA	313.319
1.067	ANSYS Inc	297.484
74.037	Virgin Galactic Holdings Inc	292.857
3.800	Hexcel Corp	272.210
2.268	QUALCOMM Inc	271.974
1.971	Airbus SE	270.612
6.300	NEC Corp	269.293
308	TransDigm Group Inc	265.274
2.904	Hanwha Aerospace Co Ltd	258.716
69.846	Planet Labs PBC	257.161
2.672	Advanced Micro Devices Inc	255.006
92.300	Singapore Technologies Engineering Ltd	252.553
5.191	Trimble Inc	242.175
3.350	Okta Inc Class A	231.164
605	Deere & Co	229.760
16.200	Mitsubishi Electric Corp	201.371
36.300	Toray Industries Inc	182.409
41.200	Shanghai Huace Navigation Technology Ltd Class A	174.814
15.950	Kratos Defense & Security Solutions Inc	170.723
36.000	Universal Microwave Technology Inc	170.089
954	Analog Devices Inc	169.779
2.600	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	164.594
42.300	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	159.110
1.124	Amazon.com Inc	133.297
365	NVIDIA Corp	125.138

Next Generation Space Economy – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
3.237	Leidos Holdings Inc	319.501
3.241	RTX Corp	277.586
2.563	Moog Inc Class A	263.641
55.400	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	251.729
16.545	Kratos Defense & Security Solutions Inc	241.186
40.892	Rocket Lab USA Inc	232.823
2.600	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	206.134
1.529	Airbus SE	200.916
1.722	Advanced Micro Devices Inc	184.615
183	TransDigm Group Inc	171.360
30.747	Universal Microwave Technology Inc	166.582
7.662	Smiths Group Plc	161.528
2.984	Ball Corp	160.555
1.152	Jacobs Solutions Inc	147.477
931	Safran SA	139.046
951	Snowflake Inc Class A	131.087
2.358	Uber Technologies Inc	118.595
977	Arista Networks Inc	111.517
1.095	Crowdstrike Holdings Inc Class A	106.002
299	NVIDIA Corp	99.162
1.621	Intellian Technologies Inc	98.374
842	Zscaler Inc	92.109
353	Motorola Solutions Inc	91.835
1.600	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	90.630
30.074	Virgin Galactic Holdings Inc	89.185
994	Okta Inc Class A	80.669
500	Palo Alto Networks Inc	67.931
99	Lockheed Martin Corp	48.330

Resonsible Asian Debt – Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
2.700.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/11/2023	2.694.839
2.500.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024	2.483.629
1.700.000	Pertamina Persero PT, 6.50%, 27/05/2041	1.694.891
750.000	Indonesia Government International Bond, 8.50%, 12/10/2035	980.550
1.000.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 6.15%, 21/05/2048	975.000
950.000	Mongolia Government International Bond, 8.65%, 19/01/2028	961.604
1.000.000	Mongolia Government International Bond, 5.13%, 07/04/2026	897.500
784.000	Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034	784.000
780.000	State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028	777.644
750.000	Indonesia Government International Bond, 4.85%, 11/01/2033	739.860
900.000	Indonesia Government International Bond, 1.10%, 12/03/2033	730.909
700.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024	666.660
600.000	Export-Import Bank of Korea, 5.00%, 11/01/2028	620.406
600.000	Standard Chartered Plc, 6.30%, 09/01/2029	619.840
600.000	AIA Group Ltd, 4.95%, 04/04/2033	602.066
600.000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd, 4.88%, 21/09/2025	597.598
600.000	Bank of China Ltd, 5.00%, 13/11/2024	593.249
500.000	Philippine Government International Bond, 6.38%, 23/10/2034	566.875
600.000	Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027	561.470
600.000	United Overseas Bank Ltd, 3.86%, 07/10/2032	560.691

Responsible Asian Debt – Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
1.000.000	Mongolia Government International Bond, 5.13%, 07/04/2026	953.800
1.000.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 6.15%, 21/05/2048	902.550
700.000	Indonesia Government International Bond, 5.25%, 17/01/2042	694.112
1.100.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 3.10%, 08/01/2051	661.903
600.000	GENM Capital Labuan Ltd, 3.88%, 19/04/2031	471.300
500.000	Chinalco Capital Holdings Ltd, 2.13%, 03/06/2026	455.773
444.000	Philippine Government International Bond, 5.50%, 17/01/2048	447.645
454.000	China Life Insurance Overseas Co Ltd, 5.35%, 15/08/2033	440.888
400.000	ABJA Investment Co Pte Ltd, 5.45%, 24/01/2028	400.480
400.000	CLP Power HK Finance Ltd, 3.55%, 29/12/2049	381.500
380.000	State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028	377.940
375.000	ROP Sukuk Trust, 5.05%, 06/06/2029	374.681
400.000	Sands China Ltd, 5.65%, 08/08/2028	368.800
600.000	Longfor Group Holdings Ltd, 3.95%, 16/09/2029	361.500
400.000	Melco Resorts Finance Ltd, 5.75%, 21/07/2028	339.200
400.000	Wynn Macau Ltd, 5.63%, 26/08/2028	335.000
400.000	Studio City Finance Ltd, 6.50%, 15/01/2028	328.080
400.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031	327.768
325.000	Shinhan Bank Co Ltd, 4.50%, 12/04/2028	319.953
300.000	Mongolia Government International Bond, 8.65%, 19/01/2028	316.743
300.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd, 5.25%, 14/07/2033	300.900
300.000	Mongolia Government International Bond, 7.88%, 05/06/2029	300.030
300.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd, 3.38%, 29/12/2049	292.550
284.000	Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034	288.544
222.000	Philippine Government International Bond, 5.00%, 17/07/2033	222.555
400.000	Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 14/03/2024	208.080
200.000	Export-Import Bank of Korea, 5.13%, 11/01/2033	207.106
400.000	Sri Lanka Government International Bond, 6.20%, 11/05/2027	204.000
200.000	Airport Authority, 4.88%, 12/01/2030	202.350
200.000	China Resources Land Ltd, 6.00%, 27/02/2024	201.680
200.000	Airport Authority, 4.88%, 12/01/2033	201.510
200.000	Kasikornbank PCL, 5.46%, 07/03/2028	201.508
200.000	POSCO, 5.75%, 17/01/2028	200.896
200.000	AIA Group Ltd, 4.95%, 04/04/2033	200.654
200.000	Airport Authority, 4.75%, 12/01/2028	200.076
200.000	Indonesia Government International Bond, 5.65%, 11/01/2053	199.800
200.000	SK Telecom Co Ltd, 3.75%, 16/04/2023	199.348
200.000	China Construction Bank Corp, 4.25%, 27/02/2029	198.700
200.000	TNB Global Ventures Capital Bhd, 4.85%, 01/11/2028	198.340
200.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024	197.100
200.000	Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd, 4.88%, 17/08/2026	195.260
200.000	Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024	192.000

Short Duration Emerging Market Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
87.100.000	Colombia Government International Bond, 4.50%, 15/03/2029	77.586.963
74.906.000	Serbia International Bond, 3.13%, 15/05/2027	73.744.570
55.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2024	53.574.195
50.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2023	48.800.083
44.000.000	United States Treasury Note/Bond, 4.88%, 31/10/2028	44.905.781
43.930.000	Comision Federal de Electricidad, 4.69%, 15/05/2029	39.957.420
37.754.000	Korea Mine Rehabilitation & Mineral Resources Corp, 5.38%, 11/05/2028	37.463.294
42.400.000	Serbia International Bond, 1.00%, 23/09/2028	35.941.992
28.500.000	Romanian Government International Bond, 5.50%, 18/09/2028	30.484.235
24.300.000	Romanian Government International Bond, 6.63%, 27/09/2029	26.898.127
26.610.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/07/2023	25.988.349
27.280.000	Dominican Republic International Bond, 5.50%, 22/02/2029	25.674.440
25.371.000	Korea Housing Finance Corp, 4.63%, 24/02/2028	25.232.474
25.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/04/2023	24.931.594
25.000.000	United States Treasury Bill, 0.00% 02/05/2023	24.916.469
25.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/07/2023	24.597.631
25.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/09/2023	24.586.806
25.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 26/09/2023	24.565.733
24.831.000	MFB Magyar Fejlesztesi Bank Zrt, 6.50%, 29/06/2028	24.556.866
25.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024	24.334.626
24.100.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2023	24.004.654
20.000.000	Ecopetrol SA, 8.63%, 19/01/2029	20.495.000
20.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 25/04/2024	19.461.937
20.305.000	Ivory Coast Government International Bond, 5.25%, 22/03/2030	18.300.577
17.799.000	Serbia International Bond, 6.25%, 26/05/2028	17.732.610
16.930.000	Romanian Government International Bond, 2.88%, 26/05/2028	16.492.300
16.000.000	First Abu Dhabi Bank PJSC, 4.38%, 24/04/2028	15.894.240
16.157.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024	15.591.373
15.367.000	Corp Andina de Fomento, 6.00%, 26/04/2027	15.350.711
14.467.000	Commercial Bank of Dubai PSC, 5.32%, 14/06/2028	14.467.000

Short Duration Emerging Market Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
52.245.000	QatarEnergy Trading LLC, 1.38%, 12/09/2026	46.876.331
35.500.000	Egypt Government International Bond, 4.75%, 11/04/2025	33.772.405
31.971.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 16/11/2027	32.951.872
29.710.000	Qatar Government International Bond, 3.38%, 14/03/2024	29.156.851
28.660.000	QIB Sukuk Ltd, 3.98%, 26/03/2024	28.395.812
29.461.000	Egypt Government International Bond, 5.75%, 29/05/2024	26.748.498
230.000	Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund	25.766.900
25.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2023	24.944.517
25.648.000	Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd, 3.38%, 29/12/2049	24.842.605
25.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024	24.817.813
25.000.000	Rongshi International Finance Ltd, 3.25%, 21/05/2024	24.520.250
24.500.000	Colombia Government International Bond, 4.50%, 28/01/2026	23.703.750
22.000.000	QNB Finance Ltd, 3.50%, 28/03/2024	21.701.240
21.950.000	Ecopetrol SA, 4.13%, 16/01/2025	21.196.475
21.000.000	Dominican Republic International Bond, 6.88%, 29/01/2026	21.014.500
21.000.000	Dominican Republic International Bond, 5.50%, 27/01/2025	20.758.500
18.700.000	Ivory Coast Government International Bond, 5.13%, 15/06/2025	20.518.272
20.000.000	Republic of South Africa Government International Bond, 5.88%, 16/09/2025	19.911.200
20.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 25/04/2024	19.551.361
18.800.000	China Huadian Overseas Development Management Co Ltd, 4.00%, 29/12/2049	18.611.640
17.799.000	Serbia International Bond, 6.25%, 26/05/2028	18.217.892
18.000.000	CCBL Cayman 1 Corp Ltd, 3.50%, 16/05/2024	17.705.480
17.240.000	Indonesia Government International Bond, 1.75%, 24/04/2025	17.511.401
18.174.000	Chinalco Capital Holdings Ltd, 2.13%, 03/06/2026	16.738.498
17.791.000	Chile Government International Bond, 2.75%, 31/01/2027	16.561.415
17.000.000	Ivory Coast Government International Bond, 6.38%, 03/03/2028	16.560.000
16.262.000	Mashreqbank PSC, 4.25%, 26/02/2024	16.127.283

Short Duration High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
9.270.000	Gen Digital Inc, 6.75%, 30/09/2027	9.309.279
9.045.000	Ally Financial Inc, 5.75%, 20/11/2025	8.850.494
8.505.000	American Airlines Inc, 7.25%, 15/02/2028	8.332.100
8.060.000	TransDigm Inc, 7.50%, 15/03/2027	8.067.694
8.665.000	Air Canada, 3.88%, 15/08/2026	7.958.854
7.700.000	Avient Corp, 5.75%, 15/05/2025	7.643.765
7.000.000	Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 10.50%, 15/02/2028	7.001.737
6.920.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co, 7.88%, 15/08/2026	6.934.400
7.370.000	EnerSys, 4.38%, 15/12/2027	6.899.014
7.150.000	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 5.13%, 01/05/2027	6.751.854
6.580.000	Civitas Resources Inc, 8.38%, 01/07/2028	6.632.342
6.800.000	Camelot Return Merger Sub Inc, 8.75%, 01/08/2028	6.519.850
6.455.000	Energizer Holdings Inc, 6.50%, 31/12/2027	6.310.174
6.710.000	Hudbay Minerals Inc, 4.50%, 01/04/2026	6.275.840
6.385.000	William Carter Co, 5.63%, 15/03/2027	6.169.770
6.840.000	Sirius XM Radio Inc, 4.00%, 15/07/2028	5.999.226
5.955.000	Regal Rexnord Corp, 6.05%, 15/02/2026	5.937.956
6.300.000	VOC Escrow Ltd, 5.00%, 15/02/2028	5.885.513
5.685.000	KB Home, 6.88%, 15/06/2027	5.794.588
5.875.000	Tenet Healthcare Corp, 6.25%, 01/02/2027	5.754.556

Short Duration High Yield SDG Engagement – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
9.384.167	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5.50%, 20/04/2026	9.215.174
8.670.000	Hudbay Minerals Inc, 4.50%, 01/04/2026	8.194.438
8.510.000	Air Canada, 3.88%, 15/08/2026	7.901.351
7.926.000	EPR Properties, 4.50%, 01/04/2025	7.657.149
7.855.000	APX Group Inc, 6.75%, 15/02/2027	7.644.344
7.795.000	LPL Holdings Inc, 4.63%, 15/11/2027	7.323.761
7.150.000	US Foods Inc, 6.25%, 15/04/2025	7.155.972
7.795.000	Garda World Security Corp, 4.63%, 15/02/2027	6.859.600
6.460.000	Ally Financial Inc, 5.75%, 20/11/2025	6.062.836
6.055.000	Avient Corp, 5.75%, 15/05/2025	6.004.844
6.330.000	Sirius XM Radio Inc, 5.00%, 01/08/2027	5.899.630
6.335.000	WR Grace Holdings LLC, 4.88%, 15/06/2027	5.789.858
6.605.000	Sunnova Energy Corp, 5.88%, 01/09/2026	5.587.166
5.525.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 22/06/2023	5.445.027
5.635.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/11/2023	5.432.745
5.620.000	Legends Hospitality Holding Co LLC/Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 5.00%, 01/02/2026	5.391.721
5.285.000	KB Home, 6.88%, 15/06/2027	5.307.568
6.205.000	Blackstone Mortgage Trust Inc, 3.75%, 15/01/2027	5.282.006
5.195.000	CSC Holdings LLC, 5.25%, 01/06/2024	5.113.474
5.115.000	Avolon Holdings Funding Ltd, 5.25%, 15/05/2024	5.053.889

Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
121.655.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 11/01/2024	120.013.014
104.355.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2046	100.850.543
100.715.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2049	96.805.117
95.955.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2043	94.319.676
92.790.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/05/2043	91.714.039
87.140.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 25/03/2044	86.072.887
86.120.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/08/2053	85.439.618
84.800.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/01/2054	84.250.155
89.340.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2053	84.182.823
87.425.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/04/2046	84.071.679
85.080.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/09/2054	83.839.496
85.405.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/12/2052	82.930.719
82.805.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/10/2054	81.058.044
86.485.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2043	79.813.359
81.905.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/11/2043	78.396.076
79.205.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/04/2043	74.857.567
75.640.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2049	74.263.671
69.930.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2053	67.601.463
70.585.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 14/09/2042	65.489.749
64.458.795	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1.63%, 15/10/2027	65.017.774
65.710.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/04/2023	65.012.607
68.135.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/08/2042	64.635.863
63.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/12/2023	62.733.334
60.170.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/05/2053	60.353.658
60.695.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/04/2054	59.532.784
60.020.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 12/10/2023	59.235.239
58.190.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2043	58.222.438

Strategic Income – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
104.355.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/05/2046	100.188.986
100.715.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2049	94.896.648
95.955.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/02/2043	94.815.429
92.790.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/05/2043	91.096.586
87.425.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/04/2046	86.437.923
86.120.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/08/2053	84.895.079
85.405.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/12/2052	84.803.962
87.140.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 25/03/2044	83.740.348
85.080.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/09/2054	83.313.757
89.340.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/07/2053	82.479.774
86.485.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/06/2043	80.301.915
81.905.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/11/2043	79.415.437
82.805.000	Fannie Mae Pool, 5.50%, 01/10/2054	79.267.725
79.205.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/04/2043	76.670.548
75.640.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/06/2049	73.071.869
69.930.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/07/2053	66.379.805
68.135.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/08/2042	64.482.404
70.585.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 14/09/2042	64.388.461
65.573.123	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1.63%, 15/10/2027	64.307.766
60.695.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/04/2054	60.873.904
60.170.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/05/2053	60.044.145
58.190.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/02/2043	58.001.891
58.115.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/02/2043	56.101.403
57.500.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/09/2043	53.955.371
55.055.000	Fannie Mae Pool, 5.00%, 01/03/2043	53.926.472
59.810.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/10/2043	52.482.690
55.750.000	Fannie Mae Pool, 4.00%, 01/03/2043	52.064.280
54.380.000	Fannie Mae Pool, 4.50%, 01/10/2042	49.238.719
50.625.000	Fannie Mae Pool, 3.50%, 01/01/2054	46.378.717

Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
1.150.000	Standard Chartered Plc, 4.30%, 29/12/2049	882.535
750.000	Standard Chartered Plc, 7.75%, 29/12/2049	758.600
667.000	Philippine Government International Bond, 5.50%, 17/01/2048	667.000
700.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 4.50%, 29/05/2029	544.750
510.000	State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028	508.460
390.000	CK Hutchison International 2 Ltd, 4.88%, 21/04/2033	388.171
400.000	Huarong Finance II Co Ltd, 4.63%, 03/06/2026	352.750
400.000	Axis Bank Ltd, 4.10%, 29/12/2049	351.000
400.000	Studio City Finance Ltd, 6.50%, 15/01/2028	349.800
350.000	Shinhan Bank Co Ltd, 4.50%, 12/04/2028	348.499
400.000	Huarong Finance 2017 Co Ltd, 4.75%, 27/04/2027	348.250
400.000	HDFC Bank Ltd, 3.70%, 29/12/2049	347.700
400.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT, 4.30%, 29/12/2049	333.300
333.000	Philippine Government International Bond, 5.00%, 17/07/2033	332.973
400.000	Melco Resorts Finance Ltd, 5.38%, 04/12/2029	331.400
400.000	Vedanta Resources Finance II Plc, 8.95%, 11/03/2025	307.000
500.000	Sino-Ocean Land Treasure III Ltd, 4.90%, 31/12/2049	300.000
300.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd, 5.25%, 14/07/2033	299.307
300.000	Korea Land and Housing, 5.75%, 06/10/2025	299.292
300.000	China CITIC Bank International, 6.00%, 05/12/2033	298.890
300.000	POSCO, 5.75%, 17/01/2028	298.524
400.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.38%, 24/02/2030	288.000
300.000	Bangkok Bank PCL, 5.00%, 29/12/2049	275.625
273.000	China Life Insurance Overseas Co Ltd, 5.35%, 15/08/2033	273.000
300.000	Krung Thai Bank PCL, 4.40%, 29/12/2049	271.500
262.000	Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034	262.000
250.000	ROP Sukuk Trust, 5.05%, 06/06/2029	250.000
250.000	Woori Bank, 4.88%, 26/01/2028	249.125
250.000	BOC Aviation USA Corp, 4.88%, 03/05/2033	247.275
229.000	Industrial Bank of Korea, 5.38%, 04/10/2028	228.187
550.000	Sri Lanka Government International Bond, 6.85%, 03/11/2025	204.600
200.000	Khazanah Capital Ltd, 4.88%, 01/06/2033	200.000
200.000	LG Energy Solution Ltd, 5.75%, 25/09/2028	199.828
200.000	REC Ltd, 5.63%, 11/04/2028	199.708
200.000	CK Hutchison International 23 Ltd, 4.75%, 21/04/2028	199.596
200.000	Hyundai Capital America, 5.68%, 26/06/2028	199.484
200.000	Airport Authority, 4.75%, 12/01/2028	199.410
200.000	Export-Import Bank of Korea, 5.13%, 11/01/2033	199.180
200.000	Airport Authority, 4.88%, 12/01/2030	198.760
200.000	Airport Authority, 4.88%, 12/01/2033	198.516
200.000	SK Hynix Inc, 6.50%, 17/01/2033	196.820
200.000	Standard Chartered Plc, 6.00%, 29/12/2049	194.500
200.000	Sands China Ltd, 5.65%, 08/08/2028	193.000
250.000	Bank of East Asia Ltd, 5.83%, 29/12/2049	191.875

Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen: (Fortsetzung)

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
200.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024	191.000
200.000	Kasikornbank PCL, 5.28%, 29/12/2049	189.300
200.000	ReNew Power Pvt Ltd, 5.88%, 05/03/2027	187.750
200.000	ENN Clean Energy International Investment Ltd, 3.38%, 12/05/2026	187.100
200.000	Huarong Finance II Co Ltd, 5.00%, 19/11/2025	183.900

Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
900.000	Sands China Ltd, 5.65%, 08/08/2028	857.840
667.000	Philippine Government International Bond, 5.50%, 17/01/2048	670.335
550.000	Standard Chartered Plc, 7.75%, 29/12/2049	532.125
510.000	State Bank of India, 4.88%, 05/05/2028	507.236
510.000	Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd, 4.88%, 17/08/2026	497.641
1.350.000	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 2.70%, 13/01/2025	453.475
390.000	CK Hutchison International 2 Ltd, 4.88%, 21/04/2033	390.027
400.000	Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027	379.200
400.000	Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024	376.500
400.000	Singapore Airlines Ltd, 3.38%, 19/01/2029	365.204
400.000	Melco Resorts Finance Ltd, 5.63%, 17/07/2027	359.000
350.000	Shinhan Bank Co Ltd, 4.50%, 12/04/2028	349.461
400.000	Bangkok Bank PCL, 3.73%, 25/09/2034	343.988
400.000	CAS Capital No 1 Ltd, 4.00%, 29/12/2049	329.200
350.000	Ca Magnum Holdings, 5.38%, 31/10/2026	326.375
330.000	FWD Group Holdings Ltd, 8.05%, 29/12/2049	320.925
450.000	Shui On Development Holding Ltd, 6.15%, 24/08/2024	309.800
310.000	FWD Group Holdings Ltd, 5.75%, 09/07/2024	306.125
300.000	China CITIC Bank International, 6.00%, 05/12/2033	302.580
400.000	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 3.38%, 24/02/2030	302.000
300.000	POSCO, 5.75%, 17/01/2028	301.344
300.000	Hongkong Land Finance Cayman Islands Co Ltd, 5.25%, 14/07/2033	300.900
300.000	Wynn Macau Ltd, 4.88%, 01/10/2024	292.500
305.000	ReNew Power Pvt Ltd, 5.88%, 05/03/2027	286.319
273.000	China Life Insurance Overseas Co Ltd, 5.35%, 15/08/2033	268.059
300.000	Kasikornbank PCL, 3.34%, 02/10/2031	266.481
262.000	Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034	266.192
300.000	Central Plaza Development Ltd, 5.75%, 29/12/2049	265.800
300.000	Krung Thai Bank PCL, 4.40%, 29/12/2049	265.125
300.000	Melco Resorts Finance Ltd, 5.75%, 21/07/2028	259.500
250.000	Woori Bank, 4.88%, 26/01/2028	255.375
350.000	PCPD Capital Ltd, 5.13%, 18/06/2026	253.750
250.000	ROP Sukuk Trust, 5.05%, 06/06/2029	249.788
250.000	BOC Aviation USA Corp, 4.88%, 03/05/2033	248.435
300.000	GENM Capital Labuan Ltd, 3.88%, 19/04/2031	243.000
300.000	Elect Global Investments Ltd, 4.10%, 29/12/2049	238.350
200.000	Export-Import Bank of Korea, 5.13%, 11/01/2033	208.362
200.000	Airport Authority, 4.88%, 12/01/2030	202.350
200.000	Airport Authority, 4.88%, 12/01/2033	201.510
200.000	CK Hutchison International 23 Ltd, 4.75%, 21/04/2028	200.586
200.000	Khazanah Capital Ltd, 4.88%, 01/06/2033	200.538
200.000	Airport Authority, 4.75%, 12/01/2028	200.398
200.000	REC Ltd, 5.63%, 11/04/2028	199.782
200.000	Medco Oak Tree Pte Ltd, 7.38%, 14/05/2026	199.500

Sustainable Asia High Yield – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen (Fortsetzung):

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
200.000	Celestial Miles Ltd, 5.75%, 29/12/2049	198.000
200.000	Adani Green Energy UP Ltd/Prayatna Developers Pvt Ltd/Parampujya Solar Energy, 6.25%, 10/12/2024	197.100
200.000	Periama Holdings LLC, 5.95%, 19/04/2026	195.300
200.000	MGM China Holdings Ltd, 5.88%, 15/05/2026	192.500
260.000	NWD MTN Ltd, 4.13%, 18/07/2029	191.152
350.000	Sino-Ocean Land Treasure Finance I Ltd, 6.00%, 30/07/2024	185.500
200.000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT, 3.75%, 30/03/2026	185.440

Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
887.000	Ecopetrol SA, 8.88%, 13/01/2033	879.875
851.000	Banco do Brasil SA, 6.25%, 18/04/2030	839.188
800.000	Kosmos Energy Ltd, 7.13%, 04/04/2026	722.050
726.000	Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033	721.150
640.000	Adib Sukuk Co II Ltd, 5.70%, 15/11/2028	640.000
643.000	Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033	635.599
559.000	Israel Discount Bank Ltd, 5.38%, 26/01/2028	559.767
600.000	KazMunayGas National Co JSC, 4.75%, 19/04/2027	556.245
600.000	Medco Bell Pte Ltd, 6.38%, 30/01/2027	549.800
546.000	Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034	537.170
534.000	Cemex SAB de CV, 9.13%, 29/12/2049	534.000
485.000	Bank Gospodarstwa Krajowego, 5.13%, 22/02/2033	516.994
509.000	Azul Secured Finance LLP, 11.93%, 28/08/2028	502.749
495.000	Yapi ve Kredi Bankasi AS, 9.25%, 16/10/2028	492.431
500.000	Cencosud SA, 4.38%, 17/07/2027	485.000
483.000	Standard Chartered Plc, 6.30%, 06/07/2034	483.000
540.000	Millicom International Cellular SA, 6.25%, 25/03/2029	480.330
600.000	Vedanta Resources Finance II Plc, 8.95%, 11/03/2025	457.900
500.000	Cia de Minas Buenaventura SAA, 5.50%, 23/07/2026	455.150
550.000	KazMunayGas National Co JSC, 5.75%, 19/04/2047	453.400

Sustainable Emerging Market Corporate Debt – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
726.000	Romanian Government International Bond, 7.13%, 17/01/2033	720.555
656.000	Colombia Government International Bond, 8.00%, 20/04/2033	686.242
688.000	First Quantum Minerals Ltd, 6.88%, 15/10/2027	644.600
643.000	Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033	634.523
700.000	Trust Fibra Uno, 4.87%, 15/01/2030	609.000
574.000	Celestial Miles Ltd, 5.75%, 29/12/2049	567.360
559.000	Israel Discount Bank Ltd, 5.38%, 26/01/2028	559.154
600.000	Cencosud SA, 4.38%, 17/07/2027	556.620
600.000	Vedanta Resources Finance II Plc, 13.88%, 21/01/2024	548.960
546.000	Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034	532.721
509.000	Azul Secured Finance LLP, 11.93%, 28/08/2028	504.212
500.000	Banco do Brasil SA, 6.25%, 18/04/2030	493.000
557.000	Alpek SAB de CV, 4.25%, 18/09/2029	491.725
479.000	Medco Oak Tree Pte Ltd, 7.38%, 14/05/2026	475.013
531.000	Endeavour Mining Plc, 5.00%, 14/10/2026	474.963
500.000	China Construction Bank Corp, 2.45%, 24/06/2030	470.194
536.000	Stillwater Mining Co, 4.00%, 16/11/2026	466.538
446.000	Shinhan Financial Group Co Ltd, 5.88%, 29/12/2049	440.209
500.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd, 2.30%, 08/01/2031	439.560
407.000	Republic of Poland Government International Bond, 4.25%, 14/02/2043	428.313

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
14.534.000	Colombia Government International Bond, 7.50%, 02/02/2034	13.968.140
12.599.000	Morocco Government International Bond, 6.50%, 08/09/2033	12.470.210
13.320.000	Romanian Government International Bond, 3.75%, 07/02/2034	11.742.561
37.038.444	Argentine Republic Government International Bond, 3.63%, 09/07/2035	10.249.274
10.523.000	Oman Government International Bond, 6.75%, 17/01/2048	10.147.861
11.448.000	Peruvian Government International Bond, 1.25%, 11/03/2033	9.394.305
9.446.000	Brazilian Government International Bond, 6.00%, 20/10/2033	9.284.352
11.079.000	Morocco Government International Bond, 3.00%, 15/12/2032	8.781.731
9.060.000	Chile Government International Bond, 1.88%, 27/05/2030	8.726.997
10.140.000	Serbia International Bond, 1.50%, 26/06/2029	8.659.958
9.283.000	Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033	8.640.375
8.888.000	Mexico Government International Bond, 5.75%, 12/10/2110	7.832.506
10.732.000	Serbia International Bond, 1.65%, 03/03/2033	7.777.166
19.045.739	Ecuador Government International Bond, 3.50%, 31/07/2035	6.829.418
8.035.000	Brazilian Government International Bond, 5.63%, 21/02/2047	6.593.288
6.785.000	Romanian Government International Bond, 3.62%, 26/05/2030	6.387.215
10.267.000	El Salvador Government International Bond, 9.50%, 15/07/2052	6.329.536
6.950.000	Republic of Armenia International Bond, 3.95%, 26/09/2029	5.775.700
17.900.785	Argentine Republic Government International Bond, 0.75%, 09/07/2030	5.545.816
4.956.000	Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035	5.169.653
7.630.000	Ghana Government International Bond, 10.75%, 14/10/2030	5.132.707
5.700.000	Chile Government International Bond, 3.50%, 31/01/2034	5.021.245
4.759.000	Costa Rica Government International Bond, 6.55%, 03/04/2034	4.790.132
4.110.000	Hungary Government International Bond, 7.63%, 29/03/2041	4.706.266
4.438.000	Peruvian Government International Bond, 3.75%, 01/03/2030	4.705.852
5.843.000	Peruvian Government International Bond, 1.95%, 17/11/2036	4.601.609
5.160.000	Romanian Government International Bond, 3.88%, 29/10/2035	4.525.939
4.391.000	Turkiye Government International Bond, 9.13%, 13/07/2030	4.391.751
4.225.000	Panama Government International Bond, 6.85%, 28/03/2054	4.345.906
5.400.000	Mexico Government International Bond, 2.25%, 12/08/2036	4.296.966
5.440.000	Dominican Republic International Bond, 5.88%, 30/01/2060	4.270.387
4.180.000	Costa Rica Government International Bond, 7.16%, 12/03/2045	4.176.121
7.733.000	El Salvador Government International Bond, 7.65%, 15/06/2035	4.163.440
5.040.000	Romanian Government International Bond, 4.63%, 03/04/2049	4.134.243

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
15.555.000	Oman Government International Bond, 6.75%, 17/01/2048	14.092.617
25.052.412	Ecuador Government International Bond, 3.50%, 31/07/2035	8.743.288
6.900.000	Morocco Government International Bond, 5.50%, 11/12/2042	5.963.093
6.125.000	Panama Government International Bond, 6.40%, 14/02/2035	5.928.929
5.730.000	Oman Government International Bond, 6.25%, 25/01/2031	5.626.756
4.890.000	Uruguay Government International Bond, 4.38%, 23/01/2031	4.777.537
5.526.000	Romanian Government International Bond, 4.63%, 03/04/2049	4.700.377
5.680.000	Chile Government International Bond, 2.55%, 27/07/2033	4.608.970
4.391.000	Turkiye Government International Bond, 9.13%, 13/07/2030	4.368.554
4.110.000	Hungary Government International Bond, 7.63%, 29/03/2041	4.311.429
15.562.273	Argentine Republic Government International Bond, 3.63%, 09/07/2035	4.217.706
3.870.000	Republic of Uzbekistan International Bond, 4.75%, 20/02/2024	3.832.925
4.225.000	Panama Government International Bond, 6.85%, 28/03/2054	3.829.963
4.730.000	Brazilian Government International Bond, 5.63%, 21/02/2047	3.775.691
3.943.000	Republic of Uzbekistan International Bond, 5.38%, 20/02/2029	3.665.092
4.540.000	Morocco Government International Bond, 3.00%, 15/12/2032	3.648.522
3.670.000	Costa Rica Government International Bond, 7.16%, 12/03/2045	3.605.247
3.761.000	Dominican Republic International Bond, 6.00%, 22/02/2033	3.436.314
4.140.000	Peruvian Government International Bond, 3.00%, 15/01/2034	3.378.760
2.593.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.50%, 04/04/2053	2.599.722
2.473.000	Morocco Government International Bond, 6.50%, 08/09/2033	2.551.897
2.410.000	UAE International Government Bond, 4.95%, 07/07/2052	2.362.282
2.415.000	Panama Government International Bond, 6.70%, 26/01/2036	2.356.074
2.450.000	Colombia Government International Bond, 3.88%, 25/04/2027	2.326.841
4.467.410	Ecuador Government International Bond, 6.00%, 31/07/2030	2.138.269
2.300.000	Brazilian Government International Bond, 5.63%, 07/01/2041	2.042.134
2.958.000	Panama Government International Bond, 4.50%, 01/04/2056	1.919.063
1.810.000	Republic of Poland Government International Bond, 5.75%, 16/11/2032	1.899.417
2.090.000	Romanian Government International Bond, 3.88%, 29/10/2035	1.815.239
2.309.000	Hungary Government International Bond, 1.75%, 05/06/2035	1.793.177

Tactical Macro – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
12.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2024	11.924.693
7.500.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 21/11/2023	7.379.206
5.200.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 15/02/2024	5.157.946
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 21/09/2023	4.947.567
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/02/2024	4.923.300
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2023	4.923.224
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/03/2024	4.914.450
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024	4.914.168
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024	4.892.957
4.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/11/2023	3.946.001
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2024	2.923.660
547.700	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/03/2024	541.840
548.800	United States Treasury Bill, 0.00%, 19/03/2024	541.831

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
5.194.200	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/01/2024	5.164.103
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 14/03/2024	4.927.465
5.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 18/04/2024	4.903.034
3.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2024	2.930.182

Ultra Short Term Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten EUR
23.000.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 2.88%, 28/11/2024	22.816.000
23.000.000	Aegon Bank NV, 0.38%, 21/11/2024	22.249.092
15.000.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp, 3.60%, 16/02/2026	14.948.874
15.000.000	Bank of Nova Scotia, 3.05%, 31/10/2024	14.865.900
14.000.000	Credit Mutuel Home Loan SFH SA, 0.63%, 10/02/2025	13.440.660
13.000.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 3.44%, 04/04/2025	12.954.790
12.000.000	Toronto-Dominion Bank, 3.77%, 08/09/2026	11.998.548
11.400.000	Traton Finance Luxembourg SA, 4.13%, 18/01/2025	11.340.300
11.000.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.38%, 30/09/2024	10.625.620
10.026.000	Islandsbanki HF, 7.38%, 17/05/2026	10.395.258
10.000.000	Westpac Banking Corp, 3.46%, 04/04/2025	10.004.890
10.000.000	Lloyds Bank Plc, 3.25%, 02/02/2026	9.948.440
9.839.765	Dutch Property Finance BV Series 2021-2 Class A, 4.65%, 28/04/2059	9.782.694
10.000.000	NatWest Group Plc, 1.75%, 02/03/2026	9.618.000
10.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.38%, 10/03/2026	9.214.700
9.000.000	Finland T-Bill, 0.00%, 13/02/2024	8.792.007
9.000.000	BPCE SFH SA, 0.13%, 31/03/2025	8.462.160
8.800.000	Credit Agricole Home Loan SFH SA, 0.13%, 16/12/2024	8.439.240
8.000.000	Banco Santander SA, 0.10%, 26/01/2025	7.954.000
8.300.000	US Bancorp, 0.85%, 07/06/2024	7.953.551

Ultra Short Term Euro Bond – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse EUR
16.900.000	Goldman Sachs Group Inc, 1.38%, 15/05/2024	16.562.790
11.300.000	Toronto-Dominion Bank, 3.77%, 08/09/2026	11.452.443
10.000.000	Danske Bank A/S, 0.01%, 10/11/2024	9.959.250
9.000.000	ALD SA, 1.25%, 02/03/2026	8.347.654
8.000.000	Barclays Plc, 3.38%, 02/04/2025	7.931.620
8.084.000	Commerzbank AG, 0.10%, 11/09/2025	7.518.035
7.430.000	European Financial Stability Facility, 3.50%, 11/04/2029	7.427.771
7.000.000	Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2.88%, 15/01/2026	6.883.080
6.819.490	MIRAVET Sarl Series 2019-1 Class A, 4.71%, 26/05/2065	6.737.833
6.770.000	Heimstaden Bostad AB, 2.13%, 05/09/2023	6.652.291
6.000.000	Nationale-Nederlanden Bank NV, 1.00%, 25/09/2028	5.447.070
5.100.000	Federation des Caisses Desjardins du Quebec, 3.25%, 18/04/2028	5.081.988
5.000.000	Lloyds Bank Plc, 3.25%, 02/02/2026	5.018.500
5.300.000	Bayer AG, 0.05%, 12/01/2025	4.983.590
5.000.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0.38%, 10/03/2026	4.711.750
4.820.000	Slovakia Government Bond, 3.75%, 23/02/2035	4.684.200
5.000.000	NatWest Markets Plc, 0.13%, 12/11/2025	4.606.985
5.000.000	UniCredit SpA, 0.33%, 19/01/2026	4.543.000
4.400.000	Croatia Government International Bond, 4.00%, 14/06/2035	4.492.035
4.250.000	Nationwide Building Society, 4.50%, 01/11/2026	4.269.763

Uncorrelated Strategies – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
1.128.426	Dr ING hc F Porsche AG	138.213.886
130.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2023	128.067.935
125.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/01/2024	124.086.632
125.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/02/2024	123.925.503
125.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2023	123.811.832
125.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 15/02/2024	123.724.654
125.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 29/02/2024	123.379.774
125.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/07/2023	122.985.000
115.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023	113.258.204
110.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 05/12/2023	109.222.373
110.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/01/2024	109.150.520
110.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/11/2023	108.965.120
110.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/11/2023	108.893.230
105.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2023	103.435.935
105.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023	103.366.105
105.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2023	103.345.974
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 04/01/2024	98.640.444
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023	98.511.500
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 22/06/2023	98.489.108
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2023	98.485.667
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023	98.450.272
90.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2023	89.031.525
85.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 31/10/2023	84.082.097
85.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/08/2023	83.648.875
80.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/11/2023	79.135.927
80.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/08/2023	78.830.584
80.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023	78.737.146
80.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 10/08/2023	78.646.413
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023	68.940.999
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023	68.927.397
60.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 31/08/2023	59.160.068

Uncorrelated Strategies – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
1.192.243	Dr ING hc F Porsche AG	146.198.495
105.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 02/05/2023	104.935.731
100.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023	99.940.867
90.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 24/10/2023	89.920.793
85.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 31/10/2023	84.837.565
75.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/04/2023	74.976.259
70.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 01/08/2023	69.782.496
60.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 07/11/2023	59.859.787
45.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023	44.983.873
21.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 17/10/2023	20.981.547
20.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2023	19.974.517
17.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023	16.980.617
10.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/04/2023	9.991.917

Uncorrelated Trading – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
48.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 09/05/2023	47.273.120
47.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023	46.268.638
45.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/03/2023	44.549.925
41.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023	40.379.012
40.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 23/05/2023	39.394.857
24.000.000	Siemens Energy Finance BV, 5.63%, 14/09/2025	35.087.468
30.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 16/05/2023	29.553.450
16.500.000	Palo Alto Networks Inc, 0.38%, 01/06/2025	27.941.707
2.480.000.000	ANA Holdings Inc, 0.00%, 10/12/2031	20.443.011
20.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023	19.693.542
20.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023	19.690.054
966.454	Volvo AB	19.309.920
1.788.123	Deutsche Lufthansa AG	18.944.704
14.700.000	Deutsche Lufthansa AG, 2.00%, 17/11/2025	17.978.801
15.800.000	Sasol Financing USA LLC, 4.50%, 08/11/2027	16.913.853
115.833	Safran SA	16.622.731
16.200.000	Live Nation Entertainment Inc, 3.13%, 15/01/2029	16.324.209
101.262	Siemens AG	15.830.224
11.461.000	Safran SA, 0.88%, 15/05/2027	15.082.689
15.800.000	Dufry One BV, 0.75%, 30/03/2026	14.749.192

Uncorrelated Trading - Hard Currency – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

20 größte Verkäufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
47.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 08/06/2023	46.880.087
47.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 13/06/2023	46.849.332
29.400.000	Siemens Energy Finance BV, 5.63%, 14/09/2025	45.327.951
41.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 06/06/2023	40.907.674
16.500.000	Palo Alto Networks Inc, 0.38%, 01/06/2025	32.177.849
3.870.000.000	ANA Holdings Inc, 0.00%, 10/12/2031	31.554.679
21.500.000	Deutsche Lufthansa AG, 2.00%, 17/11/2025	26.831.904
2.390.219	Deutsche Lufthansa AG	25.303.215
1.240.354	Volvo AB	24.835.786
23.200.000	Sasol Financing USA LLC, 4.50%, 08/11/2027	24.347.278
24.800.000	Dufry One BV, 0.75%, 30/03/2026	23.524.721
150.399	Safran SA	21.685.835
20.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023	19.984.672
20.000.000	United States Treasury Bill, 0.00%, 27/06/2023	19.896.079
13.400.000	Safran SA, 0.88%, 15/05/2027	18.621.023
142.659	Dr ING hc F Porsche AG	17.476.232
107.740	Siemens AG	16.872.187
15.400.000	ELM BV for Swiss Re Ltd, 3.25%, 13/06/2024	16.552.561
21.300.000	ams-OSRAM AG, 2.13%, 03/11/2027	16.157.884
8.612.639	Melrose Industries Plc	16.121.277

US Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
5.059	Microsoft Corp	1.478.326
9.222	Amazon.com Inc	1.079.116
25.230	Match Group Inc	1.026.379
6.653	Dollar Tree Inc	940.653
3.338	NVIDIA Corp	937.726
1.687	Intuit Inc	768.604
29.438	Chewy Inc Class A	739.938
3.450	Salesforce Inc	637.252
4.705	Progressive Corp	624.990
4.906	Alphabet Inc Class A	599.108
1.306	Netflix Inc	521.556
7.440	NextEra Energy Inc	497.602
2.528	Workday Inc Class A	487.805
3.170	AbbVie Inc	485.754
2.719	Analog Devices Inc	479.050
1.719	McDonald's Corp	468.513
933	UnitedHealth Group Inc	455.894
984	ServiceNow Inc	453.413
13.566	Keurig Dr Pepper Inc	447.377
1.568	Meta Platforms Inc Class A	423.461
5.074	TJX Cos Inc	413.326
1.985	Equifax Inc	386.904
2.432	Johnson & Johnson	384.684
11.301	Brookfield Asset Management Ltd Class A	368.820
1.527	Visa Inc Class A	354.794
4.826	Okta Inc Class A	343.956
1.969	Apple Inc	332.138
2.033	Walmart Inc	309.313
791	Mastercard Inc Class A	303.980
2.306	TE Connectivity Ltd	294.007
1.299	Avery Dennison Corp	222.974
487	Adobe Inc	218.250

US Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
6.930	Apple Inc	1.167.596
3.645	Microsoft Corp	1.148.302
1.414	ServiceNow Inc	773.172
1.770	NVIDIA Corp	748.857
6.259	Alphabet Inc Class A	641.427
2.468	Salesforce Inc	507.696
2.133	SBA Communications Corp Class A	476.355
1.240	S&P Global Inc	441.766
4.003	Amazon.com Inc	432.751
1.975	CME Group Inc Class A	392.778
745	Adobe Inc	375.641
1.050	Home Depot Inc	327.657
2.792	Walt Disney Co	294.571
1.171	Meta Platforms Inc Class A	280.374
2.424	NIKE Inc Class B	275.219
513	Costco Wholesale Corp	273.291
3.212	TJX Cos Inc	266.805
1.830	TE Connectivity Ltd	250.561
1.259	Analog Devices Inc	243.791
10.122	Chewy Inc Class A	232.904
948	Equifax Inc	209.937
5.713	Brookfield Corp	203.510
9.805	Kenvue Inc	194.418
806	Union Pacific Corp	163.034
1.311	Dollar Tree Inc	154.234
2.112	Okta Inc Class A	153.224
424	Netflix Inc	148.675
808	CDW Corp	146.843
606	Workday Inc Class A	144.829
534	Visa Inc Class A	123.783

US Equity Index PutWrite – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Käufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
82.300.000	United States Treasury Note/Bond, 3.50%, 15/09/2025	79.954.637
82.300.000	United States Treasury Note/Bond, 2.88%, 15/06/2025	79.515.348
79.500.000	United States Treasury Note/Bond, 4.00%, 15/12/2025	78.869.590
80.700.000	United States Treasury Note/Bond, 1.75%, 15/03/2025	76.809.094

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
72.200.000	United States Treasury Note/Bond, 0.50%, 15/03/2023	71.683.883
20.000.000	United States Treasury Note/Bond, 0.13%, 15/12/2023	19.792.188

US Large Cap Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
437.517	Johnson & Johnson	70.755.635
212.715	Becton Dickinson & Co	55.047.813
1.249.210	Exelon Corp	50.430.044
530.954	Duke Energy Corp	49.070.277
335.724	Procter & Gamble Co	48.702.971
314.031	Walmart Inc	48.098.042
578.307	Gilead Sciences Inc	46.826.911
1.169.858	Pfizer Inc	40.586.950
120.547	Berkshire Hathaway Inc Class B	39.248.493
736.837	Kroger Co	35.102.050
315.787	DTE Energy Co	33.959.342
387.100	Medtronic Plc	32.358.835
305.959	Sempra	31.859.979
57.912	UnitedHealth Group Inc	30.672.367
444.186	Mondelez International Inc Class A	30.421.924
363.923	American Electric Power Co Inc	30.347.419
108.978	McDonald's Corp	29.881.284
760.909	Verizon Communications Inc	29.657.075
409.477	Rio Tinto Plc ADR	29.639.277
600.446	Boston Scientific Corp	28.535.073
109.630	Amgen Inc	27.936.750
891.992	Bank of America Corp	27.878.702
98.172	Stryker Corp	27.533.225
616.039	Freeport-McMoRan Inc	25.623.143
226.110	ConocoPhillips	25.199.626
461.370	Las Vegas Sands Corp	25.054.050
104.751	Danaher Corp	25.018.689
833.666	CenterPoint Energy Inc	22.966.681
673.412	Truist Financial Corp	22.761.114
150.213	International Business Machines Corp	22.629.763
564.711	Comcast Corp Class A	22.213.948
112.914	CME Group Inc Class A	22.043.215
123.457	PepsiCo Inc	21.676.303
200.339	Merck & Co Inc	21.436.095
71.481	Air Products & Chemicals Inc	21.136.598
333.271	Public Service Enterprise Group Inc	21.083.505
278.278	CVS Health Corp	20.653.016
405.875	Citigroup Inc	19.722.008
78.554	Illinois Tool Works Inc	19.559.696
148.007	PNC Financial Services Group Inc	19.193.803
345.761	Agnico Eagle Mines Ltd	18.485.023

US Large Cap Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
1.678.140	Bank of America Corp	52.630.154
336.392	Chevron Corp	50.665.487
193.481	Cummins Inc	44.417.447
227.801	PepsiCo Inc	38.850.186
604.709	NextEra Energy Inc	37.616.547
99.520	Berkshire Hathaway Inc Class B	34.939.895
318.088	ConocoPhillips	34.534.629
148.546	Constellation Brands Inc Class A	33.566.402
647.221	Boston Scientific Corp	33.305.321
227.203	JPMorgan Chase & Co	32.894.440
295.320	Exxon Mobil Corp	32.117.584
366.273	Emerson Electric Co	31.609.550
351.661	RTX Corp	31.584.676
838.672	Freeport-McMoRan Inc	31.032.980
134.928	Caterpillar Inc	30.504.772
108.978	McDonald's Corp	30.180.671
60.475	Humana Inc	29.048.688
264.450	Oracle Corp	28.574.737
387.100	Medtronic Plc	28.472.682
848.870	Keurig Dr Pepper Inc	27.755.012
172.835	Johnson & Johnson	27.512.544
733.618	Truist Financial Corp	25.378.626
255.194	Morgan Stanley	24.320.227
51.136	Lockheed Martin Corp	23.049.639
48.398	Elevance Health Inc	22.943.373
28.482	Regeneron Pharmaceuticals Inc	22.902.121
72.789	Parker-Hannifin Corp	22.377.239
110.849	Honeywell International Inc	21.578.622
325.938	Rio Tinto Plc ADR	20.946.610
174.895	Walt Disney Co	19.055.219
187.889	General Electric Co	18.586.129
292.309	Johnson Controls International Plc	18.457.851
78.554	Illinois Tool Works Inc	18.227.192
272.126	MetLife Inc	17.483.267
129.705	International Business Machines Corp	17.315.371
47.154	Goldman Sachs Group Inc	17.249.129
107.988	Walmart Inc	16.920.733
110.395	Procter & Gamble Co	16.473.876
71.222	Danaher Corp	16.456.810
826.616	Regions Financial Corp	16.238.453

US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
27.693	Dollar Tree Inc	3.613.810
74.339	Match Group Inc	2.896.747
17.404	Progressive Corp	2.382.709
86.487	Kenvue Inc	2.163.253
81.790	Chewy Inc Class A	2.044.065
58.415	Keurig Dr Pepper Inc	1.944.150
28.076	NextEra Energy Inc	1.905.935
14.415	Jacobs Solutions Inc	1.745.950
3.443	Intuit Inc	1.685.936
2.104	Equinix Inc	1.644.879
13.525	Amazon.com Inc	1.611.733
44.424	FirstEnergy Corp	1.590.295
102.578	Celebration Bidco Holdings LLC	1.538.670
17.014	WEC Energy Group Inc	1.482.247
10.458	JPMorgan Chase & Co	1.430.992
7.611	Chevron Corp	1.207.509
70.264	Paramount Global Class B	1.141.298
16.900	TransUnion	1.119.447
17.441	Apollo Global Management Inc	1.074.734
3.816	McDonald's Corp	1.035.604
2.419	Netflix Inc	1.021.326
3.131	NVIDIA Corp	935.907
1.649	Thermo Fisher Scientific Inc	908.996
2.559	Goldman Sachs Group Inc	884.092
11.330	TJX Cos Inc	881.074
4.536	Equifax Inc	839.103
20.909	Enbridge Inc	771.537
2.380	Meta Platforms Inc Class A	684.302
17.596	Foot Locker Inc	670.638
3.509	Salesforce Inc	661.608
2.337	Microsoft Corp	641.754
17.867	Brookfield Corp	628.000
9.033	Freshpet Inc	593.758
3.977	Walmart Inc	592.904
5.977	Lamb Weston Holdings Inc	589.367

US Long Short Equity – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
24.026	Apple Inc	4.131.807
16.195	Meta Platforms Inc Class A	4.078.929
6.820	Adobe Inc	3.386.211
46.470	Apollo Global Management Inc	3.360.928
10.140	Microsoft Corp	3.264.823
26.171	Amazon.com Inc	3.108.442
13.833	Salesforce Inc	2.887.670
73.622	Enbridge Inc	2.473.749
6.077	S&P Global Inc	2.200.238
30.016	NextEra Energy Inc	2.059.562
14.511	TE Connectivity Ltd	1.898.214
14.020	Dollar Tree Inc	1.803.036
3.005	ServiceNow Inc	1.765.653
19.634	TJX Cos Inc	1.723.954
6.966	Equifax Inc	1.607.203
7.295	CME Group Inc Class A	1.590.881
2.744	Costco Wholesale Corp	1.555.095
32.249	nVent Electric Plc	1.460.180
27.799	Fidelity National Information Services Inc	1.452.855
6.517	Union Pacific Corp	1.449.591
7.561	Analog Devices Inc	1.441.330
883.014	Anagram Holdings LLC/Anagram International Inc, 15.00%, 15/08/2025	1.410.556
60.653	Kenvue Inc	1.385.319
9.326	JPMorgan Chase & Co	1.334.116
12.842	Walt Disney Co	1.313.471
9.829	Alphabet Inc Class A	1.239.700
7.708	Progressive Corp	1.171.422
7.105	Procter & Gamble Co	1.068.996
1.854	UnitedHealth Group Inc	980.537
3.079	Home Depot Inc	971.923
8.081	NIKE Inc Class B	945.550
4.038	CDW Corp	881.749
10.434	Ashland Inc	879.664

US Multi Cap Opportunities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

20 größte Käufe:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
86.000	EOG Resources Inc	10.342.721
32.000	Verisk Analytics Inc Class A	5.754.651
33.000	Avery Dennison Corp	5.721.378
78.000	TransUnion	5.546.456
47.000	Oracle Corp	4.950.177
26.000	Dollar Tree Inc	3.801.155
50.000	Veralto Corp	3.623.270
23.000	Electronic Arts Inc	2.882.438
29.800	RTX Corp	2.575.882
63.000	Simply Good Foods Co	2.242.428
60.000	Aramark	1.730.580
40.000	Brookfield Corp	1.315.145
7.400	WD-40 Co	1.274.002
75.000	Vestis Corp	1.154.729
8.800	QUALCOMM Inc	1.139.786
5.000	HCA Healthcare Inc	1.128.190
23.800	Brookfield Renewable Corp Class A	739.217
2.400	Becton Dickinson & Co	580.922
2.000	Nordson Corp	439.280
16.400	Graphic Packaging Holding Co	383.752

US Multi Cap Opportunities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
125.000	RTX Corp	12.405.764
60.000	Electronic Arts Inc	7.995.480
60.000	Dollar Tree Inc	6.813.715
25.000	HCA Healthcare Inc	6.727.073
30.000	Sherwin-Williams Co	6.616.771
19.000	Berkshire Hathaway Inc Class B	6.259.969
22.000	Motorola Solutions Inc	6.141.664
47.300	Alphabet Inc Class C	5.687.053
32.000	Apple Inc	5.462.376
66.300	Columbia Sportswear Co	5.425.567
44.000	NIKE Inc Class B	5.086.624
14.600	Microsoft Corp	4.653.098
141.300	Pfizer Inc	4.616.241
108.300	US Foods Holding Corp	4.381.397
56.700	Charles Schwab Corp	4.151.191
18.500	Lowe's Cos Inc	3.949.870
25.200	JPMorgan Chase & Co	3.815.712
51.700	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	3.757.828
155.000	Graphic Packaging Holding Co	3.706.069
38.100	Lamb Weston Holdings Inc	3.668.197
109.000	CSX Corp	3.527.807
11.400	McDonald's Corp	3.303.963
103.825	Brookfield Asset Management Ltd Class A	3.256.259
58.000	Ball Corp	3.232.886
1.100	Booking Holdings Inc	3.139.757
20.000	Eagle Materials Inc	3.125.498
37.800	Apollo Global Management Inc	3.093.384
19.200	T-Mobile US Inc	2.988.494
80.300	Brookfield Corp	2.942.318
30.200	TJX Cos Inc	2.591.078
62.500	Aramark	2.552.300
31.000	Brunswick Corp	2.515.065
26.900	Walt Disney Co	2.477.600
30.200	Mondelez International Inc Class A	2.149.251
10.000	Chubb Ltd	2.113.340
15.000	EOG Resources Inc	1.918.284
69.500	Brookfield Renewable Corp Class A	1.802.859
7.300	Nordson Corp	1.723.938

US Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
41.239	Equinix Inc	30.453.161
542.845	VICI Properties Inc Class A	17.576.334
184.332	Realty Income Corp	11.822.757
1.895.328	Hudson Pacific Properties Inc	11.687.209
56.364	AvalonBay Communities Inc	9.727.715
33.222	Public Storage	9.426.060
44.752	American Tower Corp	8.406.395
258.168	Omega Healthcare Investors Inc	8.195.886
28.710	SBA Communications Corp Class A	7.172.044
52.986	Crown Castle Inc	6.885.506
48.557	Sun Communities Inc	6.353.401
116.813	Boston Properties Inc	6.242.817
212.958	Weyerhaeuser Co	6.135.076
383.208	Urban Edge Properties	5.793.659
50.128	Simon Property Group Inc	5.692.846
77.299	Equity LifeStyle Properties Inc	5.041.087
124.381	Invitation Homes Inc	4.085.130
206.745	Kimco Realty Corp	3.788.638
111.683	Apartment Income REIT Corp	3.764.655
24.956	Extra Space Storage Inc	3.062.979
48.166	Iron Mountain Inc	2.671.652
22.566	Prologis Inc	2.597.734

US Real Estate Securities – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
227.876	Digital Realty Trust Inc	21.620.456
159.448	Prologis Inc	19.483.774
92.653	American Tower Corp	18.139.685
24.453	Equinix Inc	17.965.554
53.392	Public Storage	15.197.015
264.310	Realty Income Corp	14.875.485
186.562	Welltower Inc	14.637.481
122.843	Crown Castle Inc	14.304.964
239.399	Iron Mountain Inc	14.161.812
328.008	UDR Inc	13.396.129
345.861	Invitation Homes Inc	11.442.193
339.400	VICI Properties Inc Class A	10.365.422
538.564	Healthpeak Properties Inc	10.212.058
1.022.272	Medical Properties Trust Inc	10.129.056
146.860	Equity LifeStyle Properties Inc	9.764.888
153.464	Equity Residential	9.264.368
158.908	Boston Properties Inc	9.141.124
66.333	Sun Communities Inc	8.805.386
409.664	Kimco Realty Corp	8.366.381
45.715	EastGroup Properties Inc	8.126.633
226.961	American Homes 4 Rent Class A	8.010.555
192.153	Spirit Realty Capital Inc	7.495.440
32.826	Essex Property Trust Inc	7.231.514
223.754	Weyerhaeuser Co	7.061.285
53.721	Simon Property Group Inc	6.205.998
97.086	Rexford Industrial Realty Inc	5.819.171
39.959	Extra Space Storage Inc	5.628.658
160.172	Apartment Income REIT Corp	5.533.991
113.696	Ventas Inc	5.210.071
18.996	SBA Communications Corp Class A	4.595.055

US Small Cap – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
125.527	Tidewater Inc	5.526.299
66.785	SPX Technologies Inc	4.992.151
63.020	Arcosa Inc	4.749.192
34.658	Standex International Corp	4.658.935
12.869	Winmark Corp	4.150.126
56.908	Shift4 Payments Inc Class A	3.834.854
147.776	Stevanato Group SpA	3.642.618
141.191	Sitio Royalties Corp Class A	3.591.742
59.660	ESAB Corp	3.547.227
174.872	Element Solutions Inc	3.468.677
37.526	QuidelOrtho Corp	3.333.928
87.572	Simply Good Foods Co	3.228.912
31.175	ESCO Technologies Inc	3.121.303
73.808	Amphastar Pharmaceuticals Inc	3.086.079
149.617	Oceaneering International Inc	2.843.014
347.216	Transocean Ltd	2.740.274
47.318	Stewart Information Services Corp	2.161.529
44.347	Cactus Inc Class A	2.149.582
16.016	Rogers Corp	2.085.085
36.605	Community Bank System Inc	1.945.731
8.313	Littelfuse Inc	1.905.648
8.969	CorVel Corp	1.825.968
53.462	United Community Banks Inc	1.727.157
22.063	Casella Waste Systems Inc Class A	1.697.199
16.294	Crane Co	1.627.500
6.978	Valmont Industries Inc	1.617.289
13.623	CRA International Inc	1.572.473
54.313	Driven Brands Holdings Inc	1.502.397
21.962	CommVault Systems Inc	1.475.845
27.812	AMERISAFE Inc	1.460.703
27.138	CBIZ Inc	1.447.855
46.985	Model N Inc	1.316.292
159.502	Hillman Solutions Corp	1.308.143
7.186	FTI Consulting Inc	1.253.435
5.649	Kadant Inc	1.209.044
48.133	First Financial Bankshares Inc	1.182.868

US Small Cap – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
17.813	West Pharmaceutical Services Inc	6.420.708
47.238	Chase Corp	5.926.833
28.779	Manhattan Associates Inc	5.075.397
67.187	Forward Air Corp	4.908.464
92.496	National Instruments Corp	4.866.670
202.500	Abcam Plc ADR	4.510.964
5.452	Fair Isaac Corp	4.469.234
57.271	BOK Financial Corp	4.374.555
8.829	IDEXX Laboratories Inc	4.283.190
10.902	Pool Corp	3.886.714
251.567	Driven Brands Holdings Inc	3.849.591
70.684	XPEL Inc	3.607.511
112.053	FormFactor Inc	3.479.421
224.069	CVB Financial Corp	3.315.103
141.592	NetScout Systems Inc	3.228.259
16.153	Quaker Chemical Corp	3.043.244
31.589	Church & Dwight Co Inc	2.809.304
12.446	Zebra Technologies Corp Class A	2.576.441
14.719	SPS Commerce Inc	2.398.482
29.250	Lattice Semiconductor Corp	2.322.573
29.990	MKS Instruments Inc	2.233.692
20.032	LCI Industries	2.222.412
13.687	Novanta Inc	2.121.459
10.330	WD-40 Co	2.074.114
45.612	Bank of Hawaii Corp	2.058.432
20.158	Fox Factory Holding Corp	2.038.678
87.331	Certara Inc	2.013.263
171.792	American Software Inc Class A	1.932.724
23.321	AAON Inc	1.905.662
49.303	Artisan Partners Asset Management Inc Class A	1.904.931
11.590	Jack Henry & Associates Inc	1.701.240
8.697	FTI Consulting Inc	1.683.485

US Small Cap Intrinsic Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe

Gesamtkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe übersteigen:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Kosten US$
59.166	KBR Inc	3.239.706
63.294	Ciena Corp	2.890.579
194.736	Kyndryl Holdings Inc	2.889.504
88.811	Criteo SA ADR	2.695.917
34.434	Arcosa Inc	2.355.079
84.332	Viasat Inc	2.298.085
42.211	Devon Energy Corp	2.213.319
76.940	International Game Technology Plc	2.098.287
97.814	Semtech Corp	2.047.395
28.618	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	2.019.274
62.842	Patterson Cos Inc	1.864.256
129.808	Hain Celestial Group Inc	1.797.650
9.638	Avery Dennison Corp	1.741.680
19.906	Crown Holdings Inc	1.701.223
42.425	Portland General Electric Co	1.701.007
41.267	New Jersey Resources Corp	1.699.729
33.420	Rambus Inc	1.694.673
22.984	Acadia Healthcare Co Inc	1.693.271
40.928	Integra LifeSciences Holdings Corp	1.692.816
35.051	Northwestern Energy Group Inc	1.689.203
117.172	Stratasys Ltd	1.684.720
32.377	ALLETE Inc	1.682.244
15.764	Atmos Energy Corp	1.677.989
19.850	Ormat Technologies Inc	1.644.209
70.492	Veeco Instruments Inc	1.632.875
83.245	Cleveland-Cliffs Inc	1.509.278
210.262	Under Armour Inc Class C	1.486.693
155.429	Lions Gate Entertainment Corp Class B	1.480.642
33.189	ODP Corp	1.465.132
23.107	AerCap Holdings NV	1.404.902
77.798	Resideo Technologies Inc	1.361.641
4.480	Molina Healthcare Inc	1.338.210
47.900	Vistra Corp	1.315.914
386.389	Conduent Inc	1.280.829
97.993	Patterson-UTI Energy Inc	1.261.803
165.657	Enviri Corp	1.239.023
35.269	Coherent Corp	1.203.287
24.984	TreeHouse Foods Inc	1.190.922
67.357	TechnipFMC Plc	1.067.433
24.677	AtriCure Inc	1.053.698
18.270	Texas Capital Bancshares Inc	1.043.333

US Small Cap Intrinsic Value – Aufstellung der wesentlichen Käufe und Verkäufe (Fortsetzung)

Verkäufe insgesamt:

Anteile	Wertpapierbezeichnung	Erlöse US$
106.334	Rambus Inc	5.274.510
54.380	New Relic Inc	4.715.622
8.355	Valmont Industries Inc	1.942.270
10.236	Clean Harbors Inc	1.695.802
188.368	Chico's FAS Inc	1.409.197
21.289	KBR Inc	1.260.292
116.084	Huntington Bancshares Inc	1.128.968
22.957	Tempur Sealy International Inc	966.306
48.162	Cardiovascular Systems Inc	961.335
27.243	Spirit AeroSystems Holdings Inc Class A	942.202
9.790	Haemonetics Corp	830.418
31.986	BankUnited Inc	703.789
72.094	Sunstone Hotel Investors Inc	697.313
8.211	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	687.924
9.882	Comerica Inc	376.555
114.241	Diebold Nixdorf Inc	268.147

ANMERKUNGEN ZUM GEPRÜFTEN JAHRESABSCHLUSS

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE

Die wesentlichen vom Fonds angewandten Bilanzierungsgrundsätze sind im Folgenden beschrieben:

Grundlage für die Aufstellung des Abschlusses

Der Jahresabschluss wurde in Übereinstimmung mit dem Financial Reporting Standard („FRS") 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland" erstellt. Die in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätze für die Erstellung von Abschlüssen, die ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermitteln, sind diejenigen, die von Chartered Accountants Irland veröffentlicht und vom Financial Reporting Council („FRC") herausgegeben worden sind. Der Jahresabschluss wird ebenfalls in Übereinstimmung mit dem irischem Recht in Gestalt des Companies Act 2014 (in seiner geltenden Fassung) sowie den EG-Richtlinien über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011") (in ihrer geltenden Fassung) und dem Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank") erstellt.

Der Abschluss wird nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, berichtigt um die erfolgswirksame Neubewertung finanzieller Vermögenswerte und finanzieller Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert. Bewertungszeitpunkt ist Marktschluss am jeweiligen Handelstag. Der Handelstag ist jeder Geschäftstag oder sonstige Tag, den die Direktoren festlegen und der Verwaltungsstelle und den Anteilinhabern im Voraus mitteilen. Das Direktorium hat die Fähigkeit des Fonds zur weiteren Unternehmensfortführung bewertet und hat sich vergewissert, dass der Fonds über die Ressourcen verfügt, um seine Geschäfte auf absehbare Zeit und für mindestens zwölf Monate ab dem Datum der Genehmigung dieses Abschlusses fortzuführen. Ferner sind den Direktoren keine wesentlichen Unsicherheiten bekannt, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds zur Unternehmensfortführung wecken könnten. Der Abschluss wird daher auf der Grundlage der Unternehmensfortführung aufgestellt.

Das Format und bestimmte Passagen des Wortlauts des Abschlusses weichen in bestimmten Punkten von den im Companies Act von 2014 (in ihrer geltenden Fassung) und FRS 102 enthaltenen ab, so dass sie nach Auffassung der Direktoren den Charakter des Geschäfts des Fonds als Investmentfonds besser widerspiegeln. Der Fonds erfüllt die entsprechenden Kriterien, um von der für bestimmte offene Investmentgesellschaften nach FRS 102 möglichen Befreiung von der Erstellung einer Kapitalflussrechnung Gebrauch zu machen.

Die Aufstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit FRS 102 erfordert die Verwendung bestimmter kritischer Schätzungen bei der Rechnungslegung. Außerdem müssen die Direktoren bei der Anwendung der Bilanzierungsgrundsätze des Fonds ihr Ermessen ausüben. Die Bereiche, die ein höheres Maß an Ermessensspielraum oder Komplexität erfordern, oder solche Bereiche, in denen Annahmen und Schätzungen für den Abschluss bedeutungsvoll sind, wie die Besteuerung oder die Annahme der Unternehmensfortführung, werden in den folgenden Anmerkungen offengelegt. Angaben zu Unsicherheiten bei Annahmen und Schätzungen mit einem erheblichen Risiko daraus resultierender wesentlicher Berichtigungen der Buchwerte von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 sind in Anmerkung 12 enthalten und beziehen sich auf die Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts anhand maßgeblicher nicht beobachtbarer Parameter.

Finanzvermögen und -verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet

(i) Klassifizierung

Der Fonds wendet die Bestimmungen zu Ausweis und Bewertung des Internationalen Rechnungslegungsstandards 9: „Financial Instruments" („IFRS 9") sowie die die Offenlegungs- und Darstellungspflichten des FRS 102 auf alle Finanzinstrumente an. Gemäß IFRS 9 klassifiziert der Fonds finanzielle Vermögenswerte beim erstmaligen Ansatz als zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten oder erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Ein finanzieller Vermögenswert wird zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet, wenn er beide der folgenden Bedingungen erfüllt und nicht als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet eingestuft ist: (a) er wird im Rahmen eines Geschäftsmodells gehalten, dessen Ziel das Halten von Vermögenswerten zur Inanspruchnahme von Einnahmen ist; und (b) seine Vertragsbedingungen führen zu festgelegten Zeitpunkten zu Einnahmen, die ausschließlich Tilgung und Zinszahlungen sind (Solely payments of principal and interest, „SPPI"). Alle anderen finanziellen Vermögenswerte der Portfolios werden erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Der Fonds hat seine Anlagen als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte bzw. finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Sämtliche Derivate, die Nettoforderungen darstellen (positiver beizulegender Zeitwert), werden unter erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten ausgewiesen. Sämtliche Derivate, die Nettoverbindlichkeiten darstellen (negativer beizulegender Zeitwert), werden unter erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen.

Finanzielle Vermögenswerte, die nicht erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind unter anderem bestimmte Beträge von Brokern und Verbindlichkeiten, die zu den fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet werden.

Finanzielle Verbindlichkeiten, die nicht erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind unter anderem bestimmte an Broker zahlbare Beträge und Verbindlichkeiten, die zu den fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet werden.

(ii) Erstbewertung

Käufe und Verkäufe von Finanzinstrumenten werden in den Abschlüssen zum Handelsdatum verbucht. Realisierte Gewinne und Verluste aus Veräußerungen von Finanzinstrumenten werden anhand der „First in/First out"-Methode berechnet. Die Erstbewertung von Finanzinstrumenten, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte kategorisiert sind, erfolgt zum beizulegenden Zeitwert, und die Transaktionskosten für solche Wertpapiere werden direkt in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

Finanzvermögen und -verbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet (Fortsetzung)

(iii) Folgebewertung

Nach der Erstbewertung bewertet der Fonds Finanzinstrumente, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende finanzielle Vermögenswerte klassifiziert sind, zu ihren beizulegenden Zeitwerten. Der Zeitwert ist der Betrag, für den ein Vermögenswert in einer Transaktion zu Marktbedingungen zwischen sachverständigen, vertragswilligen Parteien getauscht oder eine Verbindlichkeit beglichen werden könnte. Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten basiert auf deren an einer anerkannten Börse notierten offiziellen Marktpreisen oder wird im Fall nicht börsennotierter Instrumente von einem angesehenen Broker/einer angesehenen Gegenpartei bezogen, jeweils zum Bilanzstichtag und ohne Abzug für geschätzte zukünftige Verkaufskosten. Gemäß IFRS 9 werden die Wertpapiere und sonstigen Vermögenswerte der Gesellschaft zum letzten Marktkurs per 31. Dezember 2023 und 2022 bewertet, um das den Inhabern rückzahlbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen („Nettovermögen") zu bestimmen.

Die Direktoren können jedoch den Wert von finanziellen Vermögenswerten anpassen, wenn sie dies für erforderlich erachten, um deren marktgerechten Wert besser widerzuspiegeln. Ist kein an einer anerkannten Börse notierter offizieller Marktpreis und kein Preis von einem Broker/einer Gegenpartei verfügbar, so wird der wahrscheinliche Realisationswert mit Sorgfalt und in gutem Glauben gemäß der Bewertungspolitik des Fonds berechnet. Dieser wahrscheinliche Realisationswert kann von der Verwaltungsstelle anhand von Bewertungsmethoden ermittelt werden, u. a. unter Zugrundelegung marktüblicher Transaktionen, Bezugnahme auf den aktuellen beizulegenden Zeitwert eines anderen Instruments, das im Wesentlichen gleich ist, Anwendung von Discounted-Cashflow-Analysen, Preisbildungsmodellen für Optionsscheine und jeder anderen Bewertungsmethode, die eine verlässliche Preisschätzung unter Annahme der gegenwärtigen Markttransaktionen ergibt. Weitere Einzelheiten zu den Bewertungsgrundsätzen für alle Wertpapierarten finden Sie im Abschnitt „Beizulegender Zeitwert von Alanlagen" in Anmerkung 12. Anschließende Änderungen im Zeitwert der Kategorie erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertende Finanzinstrumente werden in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst.

(iv) Ausbuchung finanzieller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

Der Fonds bucht einen finanziellen Vermögenswert aus, wenn die vertraglichen Ansprüche auf Einnahmen aus dem Vermögenswert erloschen sind oder wenn die Vermögenswerte übertragen werden und diese Übertragung eine Ausbuchung gemäß IFRS 9 begründet. Der Fonds bucht eine finanzielle Verbindlichkeit aus, wenn er von den entsprechenden vertraglichen Verpflichtungen befreit ist bzw. wenn diese erloschen oder abgelaufen sind.

Immobilienaktiengesellschaften

Anteile an Immobilienaktiengesellschaften, die an einem geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, werden zum letzten notierten Handelskurs oder Mittelkurs bewertet oder, sofern diese nicht erhältlich oder repräsentativ sind, zum letzten verfügbaren, für den Organismus für gemeinsame Anlagen relevant erscheinenden Nettoinventarwert („NIW").

Investmentfonds

Der beizulegende Zeitwert einer Anlage, bei der es sich um einen Anteil oder eine Beteiligung an einem Investmentfonds handelt, ist der letzte verfügbare NIW dieses Anteils bzw. dieser Beteiligung.

Mittelfristige Schuldverschreibungen

Bestimmte Portfolios können in direkte Schuldtitel investieren, bei denen es sich um Anteile an Beträgen handelt, die von Unternehmen, staatlichen Stellen oder anderen Kreditnehmern an Kreditgeber oder Kreditsyndikate geschuldet werden. Die Anlagen eines Portfolios in Kredite können in Form von Beteiligungen an Krediten oder Abtretungen aller oder eines Teils der Kredite von Dritten („Bankkredite") erfolgen. Ein Bankkredit wird häufig von einer Bank oder einem anderen Finanzinstitut (dem „Kreditgeber") verwaltet, das als Agent für alle Inhaber fungiert. Der Agent verwaltet die Bedingungen des Kredits, wie im Kreditvertrag festgelegt. Bei der Anlage in eine Kreditbeteiligung hat ein Portfolio das Recht, Kapitalzahlungen, Zinsen und etwaige Gebühren, auf die es Anspruch hat, lediglich von dem Kreditgeber zu erhalten, der den Kreditvertrag verkauft, und nur bei Eingang von Zahlungen des Kreditnehmers beim Kreditgeber. Allgemein hat ein Portfolio kein Recht, die Einhaltung der Bedingungen des Kreditvertrags mit dem Kreditnehmer durchzusetzen. Infolgedessen kann ein Portfolio dem Kreditrisiko durch sowohl den Kreditnehmer als auch durch den Kreditgeber, der den Kreditvertrag verkauft, ausgesetzt sein. Wenn ein Portfolio Abtretungen von Kreditgebern erwirbt, erwirbt es direkte Rechte gegenüber dem Kreditnehmer des Kredits.

Das Portfolio kann beim Handel mit Abtretungen und Beteiligungen an Dritte Schwierigkeiten haben. Es kann Beschränkungen für Übertragungen geben und es können nur begrenzte Möglichkeiten bestehen, solche Wertpapiere auf Sekundärmärkten zu verkaufen. Infolgedessen ist das Portfolio möglicherweise nicht in der Lage, Abtretungen oder Beteiligungen zum gewünschten Zeitpunkt zu verkaufen oder muss zu einem Preis unter dem beizulegenden Zeitwert verkaufen.

Das Portfolio kann einen Kreditvertrag über einen bestimmten zugesagten Betrag abschließen, doch wird dieser unter Umständen nicht in voller Höhe vom Kreditnehmer in Anspruch genommen. Diese nicht finanzierten Zusagen stellen die verbleibende Verpflichtung des Portfolios gegenüber dem Kreditnehmer dar. Der Kreditnehmer kann zu jedem Zeitpunkt bis zum Fälligkeitsdatum der Emission den nicht finanzierten Teil einfordern. Der beizulegende Zeitwert dieser ungedeckten Kreditzusagen ist in der Bilanz unter „Ertragsforderungen und sonstiges Vermögen" enthalten.

Participatory Notes

Die Portfolios können in Participatory Notes investieren. Participatory Notes, die voll eingezahlt sind und einen Ausübungskurs von null haben, weisen die gleichen Risiko/Rendite-Charakteristika auf, die im Falle eines direkten Kaufs der zugrunde liegenden Aktien vorliegen würden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

Forderungsbesicherte Wertpapiere und Mortgage-Backed Securities

Zu den Parametern, die dazu verwendet werden, forderungsbesicherte Wertpapiere und Mortgage-Backed Securities zu bewerten, gehören im Allgemeinen Modelle, die eine Reihe an Faktoren berücksichtigen. Hierzu können folgende Punkte gehören: vorzeitige Rückzahlungen, Cashflows, Spreadanpassungen und andere Marktinformationen wie zum Beispiel Benchmarkrenditen, gemeldete Trades, Broker-Dealer-Quotierungen, Emittentenspreads, Benchmarkwertpapiere, Gebote, Angebote und Referenzdaten wie zum Beispiel falls verfügbar Veröffentlichungen im Bereich der Marktforschung.

TBA-Wertpapiere

Die Portfolios dürfen TBA-Kaufverpflichtungen eingehen, um Wertpapiere zu einem festen Preis und zu einem über den Abrechnungszeitpunkt hinausgehenden Termin zu kaufen. Obwohl der Stückpreis festgelegt worden ist, wurde der Nominalwert noch nicht bestimmt. Bis zum Abrechnungstermin hält und verwaltet das Portfolio in Höhe des Kaufpreises der TBA-Kaufverpflichtung ausreichende Geldmittel oder erstklassige Schuldtitel. Das Portfolio kann auch andere in seinem Besitz befindlichen Wertpapiere für eine Vereinbarung zur Glattstellung der Position verwenden. Erträge aus den Wertpapieren werden erst zum Abrechnungstermin realisiert. Offene TBA-Kaufverpflichtungen wurden mit dem aktuellen Marktwert bewertet.

Die Portfolios dürfen TBA-Verkaufsverpflichtungen eingehen, um ihre Portfoliopositionen abzusichern oder um hypothekenbesicherte Wertpapiere zu verkaufen, die verzögerten Erfüllungsvereinbarungen (Delayed Delivery) unterliegen. Erlöse aus den TBA-Verkaufsverpflichtungen gelten erst zum vertraglichen Abrechnungstermin als realisiert. Solange eine TBA-Verkaufsverpflichtung nicht abgerechnet ist, hat das Portfolio ein gleichwertig erfüllbares Wertpapier oder eine glattstellende TBA-Abnahmeverpflichtung, die am oder vor dem Verkaufsverpflichtungstermin zu erfüllen ist, zur „Deckung" der Verkaufsverpflichtung zu halten. Offene TBA-Kaufverpflichtungen werden gemäß dem in den Bilanzierungsgrundsätzen beschriebenen Verfahren zum aktuellen Marktwert bewertet.

Bedingte Pflichtwandelanleihen

Bedingte Pflichtwandelanleihen (Contingent Convertible Securities, kurz „CoCos") sind eine Gattung hybrider Wertpapiere, deren Nennwert bei Eintritt bestimmter Auslöser entweder in Eigenkapital umgewandelt oder abgeschrieben wird. Die Auslöser stehen generell in Zusammenhang mit aufsichtsbehördlich vorgegebenen Kapitalquoten oder aufsichtsbehördlichen Maßnahmen, die die weitere Fähigkeit des Emittenten zur Unternehmensfortführung infrage stellen. Die einzigartigen Merkmale von CoCos zur Umwandlung in Eigenkapital oder die Abschreibung sind auf den Emittenten und dessen aufsichtsbehördliche Auflagen zugeschnitten. In aller Regel werden CoCos als nachrangige Schuldtitel begeben, um vor einer Umwandlung die entsprechende Eigenkapitalunterlegung sicherzustellen. Ferner haben CoCos nicht unbedingt eine festgesetzte Laufzeit und können absolut ermessensfreie Kupons aufweisen, die nach Ermessen des Emittenten gestrichen oder von der zuständigen Aufsichtsbehörde untersagt werden können, um dem Emittenten zu ermöglichen, Verluste zu absorbieren.

Devisenterminkontrakte

Ein Devisenterminkontrakt ist eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien, eine Währung an einem zukünftigen Datum zu einem festgelegten Preis zu kaufen und zu verkaufen. Der Marktwert eines Devisenterminkontrakts schwankt mit den Devisenterminkursen. Devisenterminkontrakte werden täglich zum Marktwert bewertet, und die Wertveränderung wird vom Portfolio als nicht realisierter Gewinn oder Verlust ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste in Höhe der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seines Abschlusses und dem Wert zum Glattstellungszeitpunkt werden nach Lieferung bzw. Entgegennahme der Währung oder, wenn ein Devisenterminkontrakt durch Eingehen eines neuen Devisenterminkontrakts mit demselben Makler glattgestellt wird, nach Abrechnung des Nettogewinns bzw. -verlusts verbucht.

Futures-Kontrakte

Futures-Kontrakte können bestimmte Optionen auf börsengehandelte Futures-Kontrakte enthalten. Anfängliche Einschüsse werden beim Eingehen der Futures-Kontrakte getätigt und erfolgen im Allgemeinen in Barmitteln oder Barmitteläquivalenten. Der beizulegende Zeitwert von Futures-Kontrakten basiert auf ihren täglich notierten Abrechnungspreisen. Veränderungen im Wert offener Futures-Kontrakte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Futures-Kontrakten bis zur Glattstellung der Kontrakte ausgewiesen, danach erfolgt der Ausweis realisierter Gewinne und Verluste. Gewinne bzw. Verluste aus offenen Futures-Kontrakten werden in der Aufstellung des Wertpapierbestands des jeweiligen Portfolios aufgeführt und in der Bilanz jeweils unter den erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten bzw. Verbindlichkeiten ausgewiesen.

Swap-Kontrakte

Ein Swap-Kontrakt ist eine außerbörsliche Vereinbarung zwischen einem Portfolio und einer Gegenpartei, die Rendite eines Instruments gegen die Rendite eines anderen Instruments zu tauschen. Manche Swap-Kontrakte werden netto abgewickelt. Beim Eingehen eines Swap-Kontrakts im Freiverkehr („OTC-Kontrakt") und während der Laufzeit der Transaktion kann das Portfolio und/oder der Swap-Kontrahent gemäß den Bestimmungen der jeweiligen Swap-Vereinbarungen Bargeld oder Wertpapiere als Sicherheiten stellen bzw. entgegennehmen, damit für den Fall eines Zahlungsausfalls oder eines Konkurses/einer Insolvenz werthaltige Vermögenswerte und Rückgriffsmöglichkeiten bereitstehen. Einige Clearingstellen bieten die Abwicklung von eingeschränkten Arten von Swaps. Bei einer abgewickelten Swap-Transaktion geht ein Portfolio die Transaktion in der Regel mit einem Finanzinstitut als Gegenpartei ein, die dann durch eine zentrale Clearingstelle abgewickelt wird. Nach Annahme eines Swaps durch eine zentrale Clearingstelle erlischt der Swap und wird durch einen Swap mit der Clearingstelle ersetzt, dadurch wird das Kreditrisiko des Portfolios gegenüber der ursprünglichen Gegenpartei reduziert oder eliminiert.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

Swap-Kontrakte (Fortsetzung)

Ein Portfolio muss in der Regel eine bestimmte Höhe einer Einschuss- und Nachschussmarge bei der Clearingstelle oder nach Weisung der Clearingstelle hinterlegen. Die tägliche Veränderung in der Bewertung wird als Forderung oder Verbindlichkeit für Nachschusszahlungen verbucht und in bar mit der zentralen Clearing-Partei abgewickelt.

Zins-/Inflation-Swaps
Ein Portfolio kann Zins- oder Inflation-Swaps eingehen. Dabei handelt es sich um Vereinbarungen zwischen zwei Parteien über den Austausch von Zahlungsströmen auf Basis eines fiktiven Kapitalbetrags, mit denen das Zinsrisiko eines Portfolios gesteuert wird. Sowohl bei Zinsswaps als auch bei Inflation-Swaps verpflichtet sich eine Partei, der Swap-Gegenpartei eine festverzinsliche Zahlung zu leisten, während die andere Partei dem Portfolio eine variabel verzinsliche Zahlung leistet. Zinsswap- und Inflation-Swapkontrakte werden täglich zum Marktwert bewertet, in manchen Fällen auf Basis von Notierungen von Kontrahenten und in anderen Fällen auf Basis von Notierungen von Kursanbietern. Die Wertveränderung wird als nicht realisierter Gewinn bzw. Verlust verbucht. Geleistete und vereinnahmte Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Einige Zinsswaps können als Forward Starting Swaps betrachtet werden. Abgrenzungen auf Forward Starting Swaps beginnen zu einem zukünftigen Zeitpunkt.

Credit Default Swaps
Ein Credit Default Swap ist ein bilateraler Finanzkontrakt, bei dem der Absicherungskäufer eine Gebühr zahlt (in der Regel ausgedrückt in Basispunkten p. a. auf den Nennbetrag) und vom Absicherungsverkäufer im Gegenzug dafür eine Zahlung erhält, wenn in Bezug auf einen Referenzemittenten ein bestimmtes Kreditereignis eintritt, wie z. B. ein Konkurs, ein Zahlungsausfall oder eine Restrukturierung. Die Kreditereignisse und Abwicklungsmechanismen, die angewandt werden, um die Ausfallzahlung zu bestimmen, werden zwischen den Kontrahenten zum Zeitpunkt des Vertragsabschlusses ausgehandelt.

Sobald der Eintritt des Kreditereignisses erklärt wird, ist der Absicherungskäufer berechtigt, den Kontrakt abzuwickeln. Die Abwicklung erfolgt in der Regel physisch, wobei der Absicherungskäufer das Recht hat, Anleihen des Referenzemittenten bis zur Höhe des Nominalwertes des Kontrakts zu liefern. Im Gegenzug erhält der Absicherungskäufer den Nennwert dieser Schuldtitel. Absicherungsverkäufe sind das synthetische Äquivalent eines Kaufs einer Anleihe oder anderen Art von Schuldtitel. Absicherungskäufe sind das Äquivalent eines synthetischen Leerverkaufs oder der Absicherung einer Anleihe oder eines anderen Kreditengagements. Bei Credit Default Swaps auf Kreditindizes leistet eine Partei einen Zahlungsstrom zugunsten einer anderen Partei und erwirbt dafür einen Anspruch auf einen bestimmten Ertrag im Falle einer Abschreibung, einer Minderung des Grundkapitals, einer Minderung der Zinsen oder des Zahlungsausfalls aller oder eines Teils der Referenzemittenten, aus denen der Kreditindex besteht. Ein Kreditindex ist eine Auswahl aus einem Korb von Kreditinstrumenten oder Engagements, die als repräsentativ für einen Teil des gesamten Kreditmarktes angesehen wird. Der Index kann unter anderem aus folgenden Komponenten bestehen: Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating, hochverzinsliche Wertpapiere, ABS-Anleihen, Schwellenmarktpapiere und/oder verschiedenen Bonitätsratings innerhalb jedes Sektors. Kreditindizes werden gehandelt, indem Credit Default Swaps mit standardisierten Bedingungen, wie z. B. einem festen Spread und standardisierten Fälligkeitsdaten eingesetzt werden. Ein Credit Default Swap auf einen Index bezieht sich auf alle Indexkomponenten, und bei Eintritt eines Zahlungsausfalls wird das Kreditereignis basierend auf der Gewichtung der Indexkomponente beglichen. Die Zusammensetzung der Indizes ändert sich regelmäßig, in der Regel alle sechs Monate, und in den meisten Indizes sind alle Komponenten gleich gewichtet.

Der Einsatz von Credit Default Swaps ist insoweit beschränkt, dass der Nutzen für das Portfolio dem Nutzen entsprechen muss, der durch ein direktes Investment in den Basisinstrumenten erzielt werden könnte, und dass die Swaps ein Portfolio keinen Risiken aussetzen dürfen, die es ansonsten nicht eingehen würde (außer dem Risiko in Bezug auf den Kontrahenten des Credit Default Swap). Die bei Abschluss bei einem Portfolio als Absicherungsverkäufer eingehende Zahlung wird in den Büchern des Portfolios als Verbindlichkeit ausgewiesen. Eine bei Abschluss von einem Portfolio als Absicherungskäufer geleistete Zahlung wird in den Büchern des Portfolios als Vermögenswert ausgewiesen. Bei einem Portfolio eingehende oder von diesem geleistete Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Credit Default Swaps werden mit Hilfe eines Pricing-Service-Anbieters bewertet. Ist kein Pricing-Service-Anbieter verfügbar, können Kontrakte täglich zum Marktpreis bewertet werden. Dabei beruht die Bewertung auf Kursnotierungen von Kontrahenten oder auf Berechnungen unter Verwendung von Bewertungsmodellen. Eine etwaige Wertveränderung wird als nicht realisierter Gewinn oder Verlust verbucht. Zahlungen, die infolge eines Kreditereignisses oder der Beendigung des Vertrages eingehen bzw. geleistet werden, werden nach Abzug eines anteiligen Betrags der Vorauszahlung als realisierte Gewinne oder Verluste verbucht.

Total Return Swaps
Total Return Swaps beinhalten die Verpflichtung zur Zahlung eines festen oder variablen Zinssatzes im Gegenzug für eine marktabhängige Rendite auf Basis eines Nominalwerts. Das Portfolio erhält eine Zahlung oder leistet eine Zahlung an die Gegenpartei in dem Maße, in dem die Gesamtrendite des Referenztitels oder -index, der dem Total Return Swap zugrunde liegt, die gegenläufige Zinsverpflichtung über- oder unterschreitet. Der Abschluss von Total Return Swaps kann mit bestimmten Risiken verbunden sein, darunter der Ausfall der Gegenpartei, Illiquidität oder ungünstige Veränderungen des Werts des zugrunde liegenden Referenztitels oder -index. Der Barausgleich in und aus den Swaps kann nach dem Ermessen des Portfoliomanagements und der Gegenpartei während der Laufzeit der Vereinbarung zu einem Reset- oder einem anderen Datum erfolgen und wird im Allgemeinen auf der Grundlage von Grenz- und Schwellenwerten bestimmt, die im Rahmen einer zwischen dem Portfoliomanagement und der Gegenpartei getroffenen Vereinbarung festgelegt werden. Bei Basket-Swaps können die Cashflows, je nach Lokalwährung der Positionen innerhalb der Swaps, auf verschiedene Fremdwährungen lauten.

Etwaige Bewertungsveränderungen werden als nicht realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Geleistete und vereinnahmte Zahlungen werden als realisierte Gewinne bzw. Verluste ausgewiesen. Der Fonds legt ausstehende Total Return Swaps am Jahresende in der Aufstellung des Wertpapierbestands offen. Für die am 31. Dezember 2023 und am 31. Dezember 2022 beendeten Geschäftsjahre ist der beizulegende Zeitwert der Total Return Swaps in der Aufstellung des Wertpapierbestands und in der Bilanz als nicht realisierter Nettogewinn oder -verlust ausgewiesen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

Swap-Kontrakte (Fortsetzung)

Volatility-Swaps
Ein Volatility-Swap ist eine Vereinbarung zwischen Gegenparteien über den Austausch regelmäßiger Zahlungen auf Basis der festgestellten Volatilität eines Referenztitels, eines Referenzindex, einer Referenzwährung oder einer anderen Referenzanlage über einen festgelegten Zeitraum. Einer der Cashflows basiert in der Regel auf der realisierten Volatilität der Referenzanlage, festgestellt anhand von Änderungen des Preises oder Kursniveaus dieser Anlage über den festgelegten Zeitraum, während der andere Cashflow auf einem spezifischen Satz basiert, der die zum Zeitpunkt der Ausführung des Swaps erwartete Volatilität der Referenzanlage oder die festgestellte Volatilität einer anderen Referenzanlage über den festgelegten Zeitraum repräsentiert. Der Wertzuwachs oder die Wertminderung eines Volatility-Swap ist in der Regel auf das Ausmaß der Volatilität der Referenzanlage bzw. den Umfang seiner Kursschwankungen während des festgelegten Zeitraums zurückzuführen und nicht auf allgemeine direktionale Kursbewegungen.

Volatility-Swaps sind ihrer Struktur nach weniger standardisiert als andere Arten von Swaps und bieten ein reines bzw. isoliertes Engagement bezogen auf das Volatilitätsrisiko der jeweils zugrunde liegenden Referenzanlage. Für gewöhnlich werden Volatility-Swaps eingesetzt, um auf künftige Schwankungsbreiten zu spekulieren, Transaktionen in Bezug auf den Spread zwischen realisierter und erwarteter Volatilität einzugehen oder das Volatilitätsrisiko der vom Portfolio gehaltenen Anlagen zu mindern.

Variance-Swaps
Variance-Swap-Kontrakte erstrecken sich auf eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien über den Austausch von Zahlungsströmen auf Basis der gemessenen Varianz (d. h. des Quadrats der Volatilität) eines bestimmten Basiswerts. Eine Partei erklärt sich im Rahmen dieser Vereinbarung bereit, einen „festen Zinssatz" oder eine Zahlung in Bezug auf den Ausübungspreis gegen einen „variablen Zinssatz" oder eine realisierte Preisvarianz des Basiswerts in Bezug auf den Nominalwert zu tauschen. Bei Vertragsabschluss wird der Ausübungspreis in der Regel so festgelegt, dass der beizulegende Zeitwert des Swaps gleich Null ist. Folglich findet bei Vertragsbeginn keinerlei Zahlungstausch statt. Am Fälligkeitstag entspricht der von einer Partei an die andere zu zahlende Betrag der Differenz zwischen der realisierten Preisvarianz des Basiswerts und dem Ausübungspreis, multipliziert mit dem Nominalwert. Ein Empfänger der realisierten Preisvarianz hätte Anspruch auf eine Zahlung, wenn die realisierte Preisvarianz des Basiswerts über dem Ausübungspreis liegt, und wäre zu einer Zahlung verpflichtet, wenn die Preisvarianz unter dem Ausübungspreis liegt. Ein Zahler der realisierten Preisvarianz wäre zu einer Zahlung verpflichtet, wenn die realisierte Preisvarianz des Basiswerts über dem Ausübungspreis liegt, und hätte Anspruch auf eine Zahlung, wenn die Preisvarianz unter dem Ausübungspreis liegt. Bei dieser Art von Vereinbarung handelt es sich im Grunde genommen um einen Terminkontrakt auf die künftige realisierte Preisvarianz des Basiswerts.

Correlation-Swaps
Ein Correlation-Swap ist ein Kontrakt, bei dem der Optionskäufer die Differenz zwischen der beobachteten Korrelation und der Korrelation zum Ausübungszeitpunkt eines Korbs von Vermögenswerten erhält, dessen Entwicklung über einen bestimmten Zeitraum beobachtet wird. Der Correlation-Swap kann als Terminkontrakt auf die realisierte Korrelation gesehen werden. Sein Auszahlungsprofil besteht einfach in der Differenz zwischen der realisierten Korrelation über den angegebenen Zeitraum und der Korrelation zum Ausübungszeitpunkt, multipliziert mit dem Nominalwert des Kontrakts. Aufgrund der Beschaffenheit des Kontrakts ist die Auszahlung mit dem Näherrücken der Fälligkeit de facto bekannt, da alle Beobachtungen für die Berechnung der Korrelation de facto bekannt sind. Daher nimmt das Modellrisiko mit zunehmender Laufzeit des Vertrags ab. Bei einem ausstehenden Kontrakt muss die implizite Korrelation für alle zukünftigen Korrelationen berechnet werden, die als Marktpreis der zukünftigen Korrelation gesehen werden können. Die implizite Korrelation bzw. Korrelationsmarke lässt sich aus beobachteten Preisen für Correlation-Swaps oder aus Notierungen von OTC-Händlern ableiten.

Optionen

Optionskontrakte können bestimmte Optionen auf börsengehandelte Futures-Kontrakte enthalten. Schreibt ein Portfolio eine Option, wird der Betrag, der der vom Portfolio erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit verbucht und anschließend der beizulegende Zeitwert der geschriebenen Option um diesen Betrag angepasst. Die Prämie auf ausgeübte geschriebene Kaufoptionen wird bei der Ermittlung des realisierten Gesamtgewinns oder -verlusts zu den Erlösen aus dem Verkauf des zugrundeliegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung hinzugerechnet. Die Prämie auf ausgeübte verkaufte Verkaufsoptionen wird von den Kosten für die erworbenen Wertpapiere, Indizes, Derivate oder Fremdwährungen abgezogen. Prämien aus geschriebenen Optionen, die verfallen, werden als realisierte Gewinne behandelt. Die Prämie auf gekaufte und ausgeübte Verkaufsoptionen wird bei Ermittlung des realisierten Gewinnes oder Verlustes vom Verkaufserlös des Basiswerts bzw. der Basiswährung abgezogen. Die Prämie auf ausgeübte gekaufte Kaufoptionen wird zu den Kosten des gekauften Wertpapiers, Index, Derivats bzw. der gekauften Währung addiert. Auf den Kauf von auslaufenden und nicht ausgeübten Optionen gezahlte Prämien werden als realisierte Verluste behandelt. Die Ausübungspreise für Optionen auf Aktienkörbe lauten auf verschiedene Fremdwährungen, je nach den Landeswährungen der Positionen in den Wertpapierkörben.

Swaptions
Schreibt ein Portfolio eine Swaption, wird ein der Prämie, die der Portfolio erhält, entsprechender Betrag als Verbindlichkeit verbucht und anschließend auf den beizulegenden Zeitwert der geschriebenen Swaption angepasst. Erhaltene Prämien aus geschriebenen Swaptions, die unausgeübt verfallen, werden vom Portfolio an den Verfallsdaten als realisierte Gewinne behandelt. Die Prämie auf ausgeübte geschriebene Payer-Swaptions wird bei der Ermittlung des realisierten Gewinns oder Verlusts zu den Erlösen aus dem Verkauf des zugrundeliegenden Swaps hinzugerechnet. Wird eine geschriebene Receiver-Swaption ausgeübt, reduziert die Prämie die Kostenbasis des gekauften Swaps.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

Optionen (Fortsetzung)

Swaptions (Fortsetzung)
Kauft ein Portfolio eine Swaption, wird ein der Prämie, die der Portfolio gezahlt hat, entsprechender Betrag als Vermögenswert verbucht und anschließend auf den beizulegenden Zeitwert der gekauften Swaption angepasst. Auf den Kauf von auslaufenden und nicht ausgeübten Swaptions gezahlte Prämien werden am Verfallsdatum als realisierte Verluste behandelt. Die Prämie auf ausgeübte gekaufte Payer-Swaptions wird bei der Feststellung, ob das betreffende Portfolio einen realisierten Gewinn oder Verlust hat, von den Erlösen des zugrundeliegenden Swaps abgezogen. Die Prämie auf ausgeübte Receiver-Swaptions wird zu der Kostenbasis der getauschten variabel verzinslichen Anlage addiert.

Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Das Portfolio kann umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen, in deren Rahmen es von einem Verkäufer Wertpapiere erwirbt (zum Beispiel eine Bank oder ein Wertpapierhändler), der zum Zeitpunkt des Verkaufs zustimmt, das Wertpapier zu einem gemeinsam festgelegten Datum und Preis zurückzukaufen und somit die Rendite für das Portfolio während der Laufzeit des umgekehrten Pensionsgeschäft festlegt. Der Rückkaufpreis ist der Kaufpreis plus ein vereinbarter Marktzins, der nicht im Zusammenhang mit dem Zinssatz oder der Fälligkeit des gekauften Wertpapiers steht. Das Portfolio kann auch umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen, in deren Rahmen es ein Wertpapier verkauft und zustimmte, es zu einem gemeinsam festgelegten Datum und Preis zurückzukaufen.

Differenzkontrakte

Differenzkontrakte werden zur Schlussnotierung des zugrundeliegenden Wertpapiers abzüglich der jedem Kontrakt zurechenbaren Finanzierungskosten (die separat verbucht werden), umgerechnet in die Basiswährung des Differenzkontrakts, bewertet. Der aktuelle Marktwert wird in der Bilanz ausgewiesen. Beim Eingehen von Differenzkontrakten kann ein Portfolio verpflichtet sein, dem Broker einen Geldbetrag und/oder andere Vermögenswerte in Höhe eines bestimmten Prozentsatzes des Kontraktwertes („Ersteinschuss") als Sicherheit zu übertragen. Anschließend werden je nach den Wertschwankungen des zugrundeliegenden Wertpapiers regelmäßig so genannte „Nachschusszahlungen" vom einem Portfolio geleistet bzw. entgegengenommen. Während der Laufzeit des Differenzkontrakts werden Wertänderungen des Kontrakts als nicht realisierte Gewinne bzw. Verluste anhand der Marktbewertungsmethode an jedem Bewertungstag erfasst, so dass der Wert des zugrundeliegenden Wertpapiers widergespiegelt wird. Bei Schließung des Kontrakts entsprechen die realisierten Gewinne oder Verluste der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung (einschließlich der Finanzierungskosten) und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schließung. Die Differenzkontrakten zuzurechnenden Dividenden (nach Abzug von Quellensteuern) werden als Dividendenforderungen oder -verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres verbucht.

Saldierung von Finanzinstrumenten

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden nur dann saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, wenn ein Rechtsanspruch besteht, die erfassten Beträge miteinander zu verrechnen und beabsichtigt wird, entweder den Ausgleich auf Nettobasis herbeizuführen oder gleichzeitig mit der Verwertung der betreffenden Vermögenswerte die dazugehörigen Verbindlichkeiten abzulösen.

Barmittel und Barmitteläquivalente

Barmittel umfassen Sichtguthaben bei Banken. Barmitteläquivalente sind kurzfristige hochliquide Investitionen, die jederzeit in festgelegte Zahlungsmittelbeträge umgewandelt werden können, nur einem unwesentlichen Wertschwankungsrisiko unterliegen und zur Begleichung kurzfristiger Barverpflichtungen und nicht für Anlagezwecke oder andere Zwecke gehalten werden. Barmittel und Barmitteläquivalente werden zu ihrem Nennwert, gegebenenfalls einschließlich aufgelaufener Zinsen, am Bewertungszeitpunkt des jeweiligen Handelstages bewertet, es sei denn, nach Einschätzung der Direktoren (in Konsultation mit dem Manager und der Verwaltungsstelle) muss eine Anpassung vorgenommen werden, damit ihr tatsächlicher Wert reflektiert wird.

Kassenbestände des Fonds
Einige der Kassenbestände des Fonds werden gemäß den Leitlinien der Central Bank of Ireland mit dem Titel „Umbrella Funds – Cash Accounts Holding Subscription, Redemption and Dividend Monies" (Kassenbestände mit Zeichnungs- Rücknahme- und Ausschüttungsgeldern) von der Verwaltungsstelle im Auftrag des Fonds gehalten. Diese Kassenbestände werden bei Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle") für den Fonds in Konten für nicht bearbeitete Zeichnungsgelder von Anlegern, an Anleger zahlbare Rücknamegelder und/oder sonstige an Anleger zahlbare Beträge gehalten und gelten als Vermögenswerte des Fonds. Jegliche zum Ende des Geschäftsjahres auf diesen Barkonten gehaltenen Gelder werden in den Gesamtbilanzen des Fonds ausgewiesen.

Forderungen von/gegenüber Brokern

Die von den Portfolios an eine Gegenpartei im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten geleistete Marge und Sicherheiten werden in der Bilanz als Forderungen gegenüber Brokern ausgewiesen. Die von der Gegenpartei an ein Portfolio im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten geleistete Marge und Sicherheiten werden in der Bilanz als Verbindlichkeiten gegenüber Brokern ausgewiesen. Bareinschüsse werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

Währungsumrechnung

Funktionale Währung und Darstellungswährung
Die funktionale und die Darstellungswährung Corporate Hybrid Bond, des Euro Bond Absolute Return, des Euro Bond, des European High Yield Bond, des European Sustainable Equity, des Macro Opportunities FX und des Ultra Short Term Euro Bond ist der Euro. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung des China A-Share Equity und des China Bond ist der CNY. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung des Japan Equity Engagement ist der JPY. Die funktionale Währung und die Darstellungswährung aller anderen Portfolios ist der US-Dollar. Da die Basiswährung des größten Teils des Nettovermögens des Fonds der US-Dollar ist, wird der US-Dollar als die am besten geeignete Konsolidierungswährung betrachtet. Weitere Einzelheiten hierzu sind in Anmerkung 15 enthalten

Transaktionen und Salden
Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf andere Währungen als die funktionale Währung des Portfolios lauten, werden zu dem am Bilanzstichtag geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Transaktionen in anderen Währungen als der funktionalen Währung des Portfolios werden zu dem am Datum der jeweiligen Transaktion geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Gewinne und Verluste aus Devisentransaktionen werden bei der Ermittlung des Jahresergebnisses in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesen.

Zeichnungsgelder und Beträge, die bei der Rücknahme rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile in anderen Währungen als der funktionalen Währung gezahlt werden, werden zu dem am Datum der jeweiligen Transaktionen geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet. Die Bilanz wird anhand der Wechselkurse zum Jahresende umgerechnet, und die Gewinn- und Verlustrechnung sowie die Aufstellung über die Entwicklung des Nettovermögens werden zum Durchschnittskurs des Jahres umgerechnet.

Verbuchung von Aufwand und Ertrag

Dividendenerträge werden in der Gewinn- und Verlustrechnung an dem Datum verbucht, an dem das betreffende Wertpapier „ex-Dividende" notiert ist, soweit die entsprechende Information dem Portfolio in angemessener Weise zur Verfügung steht. Dividenden und Zinserträge werden vor Abzug von Quellensteuern ausgewiesen, die nicht zurückgefordert werden können und gesondert in der Gewinn- und Verlustrechnung ausgewiesen werden, sowie nach Abzug von etwaigen Steuergutschriften. Zinsen aus Bankeinlagen werden auf Kassenbasis verbucht, während andere Erträge periodengerecht ausgewiesen werden.

Zinserträge werden in der Gewinn- und Verlustrechnung für alle Schuldinstrumente, die als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte klassifiziert sind, periodengerecht ausgewiesen.

Realisierte Gewinne und Verluste aus Anlagen

Realisierte Gewinne und Verluste aus der Veräußerung von finanziellen Vermögenswerten, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, werden auf einer „First in/First out"-Basis berechnet. Die damit verbundene Wechselkursbewegung zwischen dem Kauf- und dem Verkaufsdatum bei Veräußerung von erfolgswirksam zum beizulegen Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten wird in den Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten einbezogen. Anlagetransaktionen werden am Handelstag verbucht, d. h. dem Tag, an dem das Portfolio sich verpflichtet, den entsprechenden Vermögenswert zu kaufen oder zu verkaufen.

Besteuerung

Gemäß geltendem Recht und den branchenüblichen Usancen ist der Fonds als Investmentgesellschaft im Sinne von Section 739B(1) des Taxes Consolidation Act von 1997 (Gesetz zur Steuerkonsolidierung), in seiner aktuellen Fassung, anerkannt. Dementsprechend sind seine relevanten Erträge oder Kapitalgewinne in Irland nicht steuerpflichtig. Jedoch können dem Fonds beim Eintreten eines Steuertatbestands irische Steuern entstehen.

Ein Steuertatbestand umfasst Ausschüttungszahlungen an Anteilinhaber oder die Einlösung, Rücknahme oder Übertragung von Anteilen sowie das Halten von Anteilen am Ende eines jeden Achtjahreszeitraums, beginnend mit dem Erwerb der Anteile. Bei Steuertatbeständen werden für den Fonds keine irischen Steuern fällig bei:

(i) einem Anteilinhaber, der weder irischer Staatsbürger ist noch im Sinne des Steuerrechts zum Zeitpunkt des Steuertatbestands als in Irland ansässig gilt, vorausgesetzt, er hat die entsprechenden gültigen Erklärungen gemäß den Richtlinien des Taxes Consolidation Act von 1997 in der jeweils gültigen Fassung beim Fonds eingereicht, und

(ii) bestimmte steuerbefreite, in Irland ansässige Anteilinhaber, die beim Fonds die notwendigen unterzeichneten Erklärungen eingereicht haben.

In diesem Berichtszeitraum lagen keine Steuertatbestände vor.

Etwaige Veräußerungsgewinne, Dividenden und Zinsen, welche der Fonds durch seine Wertpapiere erzielt, können ggf. Quellensteuern der Länder unterliegen, aus denen diese Erträge/Gewinne erzielt werden, und diese Steuern können vom Fonds oder seinen Anteilinhabern ggf. nicht wiedererlangt werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

Besteuerung (Fortsetzung)

Der Finance Act von 2010 sieht vor, dass die Steuerbehörden Investmentfonds, die außerhalb Irlands vermarktet werden, die Genehmigung erteilen können, Zahlungen an nicht in Irland ansässige Anleger ohne Abzug der irischen Steuer zu leisten, wenn keine maßgebliche Erklärung vorliegt, sofern „äquivalente Maßnahmen" getroffen werden. Ein Fonds, der diese Genehmigung erhalten will, muss diese schriftlich bei den Steuerbehörden beantragen und die Erfüllung der maßgeblichen Bedingungen bestätigen. Die Gesellschaft hatte zum 31. Dezember 2023 und 2022 keinen Antrag auf Genehmigung bei der Revenue Commission gestellt.

Die Gesellschaft hat die Steuerposition für die offenen Steuerjahre zum 31. Dezember 2023 und 2022 überprüft und entschieden, dass keine Rückstellung für Ertragssteuern und/oder ungewisse Steuerpositionen im Abschluss der Gesellschaft erforderlich ist.

Es bestehen Unsicherheiten hinsichtlich der Auslegung komplexer Steuervorschriften und steuerrechtlicher Änderungen in Bezug auf ausländische Quellensteuern. Angesichts des breiten Spektrums an internationalen Anlagen könnten Differenzen, die sich zwischen tatsächlichen Investmenterträgen und den getroffenen Annahmen ergeben, oder künftige Änderungen an derartigen Annahmen weitere Berichtigungen des bereits erfassten Steueraufwands erfordern.

Der Fonds bildet auf der Grundlage angemessener Schätzungen Rückstellungen für die potenziellen Folgen von Prüfungen durch die Steuerbehörden der jeweiligen Länder, in denen er investiert. Die Höhe derartiger Rückstellungen richtet sich nach verschiedenen Faktoren wie Erfahrungen aus früheren Steuerprüfungen und abweichenden Auslegungen der Steuervorschriften durch das steuerpflichtige Unternehmen und die zuständige Steuerbehörde. Derartige unterschiedliche Auslegungen können sich zu vielen verschiedenen Fragen ergeben, je nach der vorliegenden Situation im Domizilland der jeweiligen Anlage. Da der Fonds die Wahrscheinlichkeit von Rechtsstreitigkeiten und anschließenden Abflüssen von Zahlungsmitteln im Hinblick auf Steuern als gering erachtet, wurde in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 keine Eventualverbindlichkeit ausgewiesen.

Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile

Die rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteile sind auf Wunsch der Anteilinhaber zurückzunehmen und werden als finanzielle Verbindlichkeiten eingestuft. Ausschüttungen auf diese Anteile werden in der Gewinn- und Verlustrechnung unter Finanzierungskosten ausgewiesen. Die rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteile können an jedem Handelstag gegen einen Barbetrag an das Portfolio zurückgegeben werden, der ihrem anteiligen Wert am NIW des Portfolios entspricht. Die rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteile werden zu dem Rücknahmebetrag ausgewiesen, der zum Bilanzstichtag zahlbar wäre, wenn der Anteilinhaber von seinem Recht auf Rückgabe des Anteils an das Portfolio Gebrauch gemacht hätte.

Ausschüttungspolitik

Die Direktoren haben beschlossen, sämtliche Nettoerträge und realisierten Nettokapitalgewinne, die den thesaurierenden Klassen zuzurechnen sind, wiederanzulegen, und sie beabsichtigen daher nicht, für Anteile dieser Klassen Dividenden festzusetzen.

Quelle der Ausschüttungen
Satzungsgemäß können die Direktoren Dividenden auf Anteile aus den Nettoerträgen (einschließlich Dividendenerträge und Zinserträge) und/oder dem Überschuss aus realisierten und nicht realisierten Gewinnen nach Abzug der realisierten und nicht realisierten Verluste aus den Anlagen des Fonds (gemeinsam „Nettoertrag") und auch aus dem Kapital beschließen. Dividenden, die aus dem Kapital gezahlt werden, kommen einer Rückzahlung oder Entnahme eines Teils der ursprünglichen Anlage eines Anteilinhabers oder aus Kapitalerträgen, die dieser ursprünglichen Anlage zuzurechnen sind, gleich. Solche Dividenden können unmittelbar zu einem Rückgang des NIW der betreffenden Anteile führen.

Die Direktoren beabsichtigen derzeit, vorbehaltlich einer „de-minimis"-Grenze, mindestens 85 % der Nettoerträge, die jeder ausschüttenden Klasse zurechenbar sind, als Dividende festzusetzen und auszuschütten; ausgenommen sind hiervon (i) die (wöchentlich) ausschüttenden Klassen, (ii) die (monatlich) ausschüttenden Klassen, (iii) die (CG) ausschüttenden Klassen und (iv) alle sonstigen ausschüttenden Klassen in einem Portfolio, die laut dem maßgeblichen Prospektzusatz Dividenden aus Kapital und Nettoertrag ausschütten. Die Anteilinhaber sollten jedoch beachten, dass die Direktoren sich in Bezug auf eine ausschüttende Klasse in ihrem eigenen Ermessen für oder gegen eine solche Festsetzung und Ausschüttung entscheiden können.

Im Bezug auf die monatlich ausschüttenden Klassen, die wöchentlich ausschüttenden Klassen und die (CG) ausschüttenden Klassen beabsichtigen die Direktoren, eine den Anteilen dieser Klassen zuweisbare, (wie zutreffend) monatliche, wöchentliche oder halbjährliche Dividende festzusetzen und zu zahlen; dies geschieht durch eine Kombination aus Nettoertrag und Kapital, so dass, falls der Nettoertrag für den entsprechenden Zeitraum weniger als der festgesetzte Betrag ist, die Differenz aus dem die betreffenden Anteile repräsentierenden Kapital gezahlt wird, was es den Klassen ermöglicht, regelmäßige, feste Dividenden auszuschütten. Falls die Nettoeinkünfte, die den (wöchentlich) ausschüttenden Klassen, den (monatlich) ausschüttenden Klassen oder den (CG) ausschüttenden Klassen zuzuschreiben sind, den Betrag übersteigen, der während des entsprechenden Zeitraums erklärt wurde, wird der Betrag der Nettoeinkünfte, der diesen Betrag übersteigt, in einem Ausschüttungskonto für die jeweiligen Anteile gehalten und bildet Teil der Dividende, die für spätere Ausschüttungszeiträume zu zahlen ist. Vorstehendes gibt die derzeitige Absicht der Direktoren bezüglich der Festsetzung und Zahlung von Dividenden für die (monatlich) ausschüttenden Klassen und die (wöchentlich) ausschüttenden Klassen wieder. Die Direktoren können sich jedoch in ihrem eigenen Ermessen gegen eine solche Festsetzung und Zahlung entscheiden, und es gibt keine Garantie dafür, dass solche Dividenden gezahlt werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

1. WESENTLICHE BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE (FORTSETZUNG)

Ausschüttungspolitik (Fortsetzung)

Ausschüttungshäufigkeit
Unter normalen Umständen beabsichtigen die Direktoren, die Dividenden wie folgt zu zahlen:

(a) Bei allen (wöchentlich) ausschüttenden Klassen in allen Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag einer jeden Woche erklärt und gezahlt;

(b) Bei allen (monatlich) ausschüttenden Klassen in allen Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag eines jeden Monats festgesetzt und drei Geschäftstage später gezahlt;

(c) bei allen (CG) ausschüttenden Klassen aller Portfolios ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden auf halbjährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt werden;

(d) bei allen anderen ausschüttenden Klassen des China Bond, des Euro Bond, des Euro Bond Absolute Return, des Global Equity Megatrends und des Ultra Short Term Euro Bond werden Dividenden vierteljährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen in Bezug auf den Nettoertrag der ausschüttenden Klassen für das vorhergehende Quartal gezahlt;

(e) bei jeder der ausschüttenden Klassen des Climate Innovation, des CLO Income, des Commodities, des Corporate Hybrid Bond, des Developed Market FMP – 2027, des Emerging Market Debt - Hard Currency, des Emerging Market Debt - Local Currency, des Emerging Market Debt Blend, des Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend, des European High Yield Bond, des Event Driven, des Global Bond, des Global Diversified Income FMP – 2024, des Global Flexible Credit Income, des Global SDG Engagement, des Global Investment Grade Credit, des Global Opportunistic Bond, des Global Real Estate Securities, des High Yield Bond, des Short Duration Emerging Market Debt, des Short Duration High Yield SDG Engagement, des Strategic Income, des Sustainable Asia High Yield, des Sustainable Emerging Market Corporate Debt, des Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency, des Tactical Macro, des US Equity Index PutWrite und des US Real Estate Securities werden Dividenden vierteljährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt;

(f) bei allen anderen ausschüttenden Klassen des US Long Short Equity ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden halbjährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt werden;

(g) Ausschüttungen der anderen ausschüttenden Klassen des Uncorrelated Strategies, des US Equity, des US Large Cap Value, des US Multi Cap Opportunities, des US Small Cap und des US Small Cap Intrinsic Value werden jährlich erklärt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt;

(h) bei allen anderen ausschüttenden Klassen aller anderen Portfolios ist beabsichtigt, dass etwaige Dividenden auf jährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen in Bezug auf den Nettoertrag der ausschüttenden Klassen für das am vorhergehenden 31. Dezember abgelaufene Kalenderjahr gezahlt werden;

(i) Bei allen (monatlich) Bruttoerträge ausschüttenden Klassen in den Portfolios werden Dividenden am oder vor dem letzten Geschäftstag eines jeden Monats festgesetzt und innerhalb von drei Geschäftstagen gezahlt; und

(j) bei allen übrigen (Brutto-)Erträge ausschüttenden Klassen in den Portfolios werden Dividenden auf vierteljährlicher Basis festgesetzt und innerhalb von dreißig Geschäftstagen gezahlt.

Unter dem Vorbehalt, dass Erträge zur Ausschüttung zur Verfügung stehen, können die Direktoren auch beschließen, für jede der ausschüttenden Klassen Zwischendividenden festzusetzen und auszuschütten. Alle Anteile einer ausschüttenden Klasse, die an einem Datum, an dem die Direktoren beschließen, für diese ausschüttende Klasse eine Dividende festzusetzen, ausgegeben sind, haben Anspruch auf diese Dividende.

Die Direktoren behalten sich das Recht vor, die Dividendenpolitik jeder Anteilklasse nach ihrem eigenen Ermessen ohne vorherige Mitteilung an die Anteilinhaber der betreffenden Klasse zu ändern. Jede Dividende, die nicht innerhalb eines Zeitraums von sechs Jahren ab dem Datum des Dividendenbeschlusses in Anspruch genommen wird, verjährt und fällt dem jeweiligen Portfolio wieder zu.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET

	5G Connectivity		Absolute Return Multi Strategy*	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Aktien	990.515.308	952.894.719	6.311	6.766
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	6.342.222	12.141.765	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	996.857.530	965.036.484	6.311	6.766
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(1.033.321)	(3.280.059)	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(1.033.321)	(3.280.059)	–	–

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	China A-Share Equity		China Bond	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	CNY	CNY	CNY	CNY
Einlagenzertifikat	–	–	58.557.000	92.924.345
Unternehmensanleihen	–	–	290.154.114	272.165.839
Aktien	13.480.937	15.317.693	–	–
Staatsanleihen	–	–	95.858.682	60.073.670
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	–	–	603.582	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	–	1.943.751	3.921.557
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	13.480.937	15.317.693	447.117.129	429.085.411
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	–	–	–	(37.837)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	–	(2.361.945)	(2.701.843)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	–	–	(2.361.945)	(2.739.680)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	China Equity		Climate Innovation[1]
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$
Aktien	171.916.351	306.849.688	2.831.398
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	547.220	1.099.861	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	172.463.571	307.949.549	2.831.398
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet			
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(423.344)	(817.712)	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(423.344)	(817.712)	–

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	CLO Income		Commodities[2]	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Agency Bonds	–	–	–	10.530.836
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	159.687.075	112.870.953	–	–
Unternehmensanleihen	–	–	77.031.796	26.223.262
Investmentfonds	12.221.060	–	–	–
Schatzwechsel	4.994.906	–	43.941.161	39.453.874
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	2.345.289	3.267.421	1.573.388	1.519.496
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	48.732	–	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	179.297.062	116.138.374	122.546.345	77.727.468
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(2.570.754)	(989.846)	(210.126)	(333.046)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(334.323)	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(2.570.754)	(1.324.169)	(210.126)	(333.046)

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Corporate Hybrid Bond		Developed Market FMP – 2027[1]
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	EUR	EUR	US$
Unternehmensanleihen	1.743.583.625	1.638.001.345	135.777.186
Investmentfonds	10.956.412	10.317.170	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	12.101.176	36.511.573	39.869
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.766.641.213	1.684.830.088	135.817.055
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet			
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	–	(37.445.575)	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(7.732.130)	(20.223.334)	(393)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(7.732.130)	(57.668.909)	(393)

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Emerging Market Debt - Hard Currency		Emerging Market Debt - Local Currency	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Einlagenzertifikat	–	–	–	18.492.177
Unternehmensanleihen	732.442.764	784.977.470	41.825.600	22.468.723
Staatsanleihen	1.794.182.602	1.508.020.941	1.124.421.834	1.280.353.016
Investmentfonds	17.580.000	16.110.000	16.173.300	15.136.550
Schatzwechsel	–	–	33.341.150	–
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	19.568.314	23.148.647	313.668	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	24.839.124	12.379.899	17.116.276	14.987.459
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	1.909.636	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	–	11.479.756	8.845.584
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	2.588.612.804	2.346.546.593	1.244.671.584	1.360.283.509
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(10.222.785)	(1.308.787)	(716.676)	(676.393)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(5.652.118)	(10.560.096)	(12.281.584)	(9.665.447)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	–	(14.977.755)	(47.106.454)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(15.874.903)	(11.868.883)	(27.976.015)	(57.448.294)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Emerging Market Debt Blend		Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Unternehmensanleihen	148.077.852	149.902.253	9.239.606	7.512.041
Staatsanleihen	330.568.106	288.112.593	48.266.565	42.285.874
Investmentfonds	14.297.035	13.380.558	–	–
Schatzwechsel	1.006.392	–	821.151	–
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	1.199.361	1.175.800	832.110	610.127
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	6.637.946	4.031.358	2.325.031	446.879
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	1.658.685	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	2.641.912	4.841.085	19.138	43.385
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	504.428.604	463.102.332	61.503.601	50.898.306
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(969.525)	(159.705)	(356.901)	(65.989)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(2.075.226)	(2.058.976)	(284.238)	(340.697)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	(5.804.925)	(11.561.405)	(38.443)	(135.722)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(8.849.676)	(13.780.086)	(679.582)	(542.408)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Emerging Markets Equity		Emerging Markets Select Equity*	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Aktien	87.302.700	188.734.006	–	90.426.979
Immobilienaktiengesellschaften	481.105	–	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	1.272.409	1.053.813	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	89.056.214	189.787.819	–	90.426.979
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(787.152)	(666.859)	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(787.152)	(666.859)	–	–

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Euro Bond		Euro Bond Absolute Return	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	EUR	EUR	EUR	EUR
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	4.100	462.816	158.727	2.319.216
Unternehmensanleihen	4.770.071	4.079.176	18.558.164	23.938.251
Staatsanleihen	5.399.389	4.005.023	14.456.150	19.650.553
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	32.300	41.432	47.035	1.497.736
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	–	25.383	39.745
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	6.642	93	26.569	61.989
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	7.001	1.858	113.881	12.884
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	10.219.503	8.590.398	33.385.909	47.520.374
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(19.007)	(82.010)	(301.831)	(103.516)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	–	(1.117.757)	(1.032.074)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	(54.486)	(6.528)	(181.087)	(32.637)
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	(3.665)	–	(14.661)	(67.569)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	(3.982)	(23.909)	–	(43.820)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(81.140)	(112.447)	(1.615.336)	(1.279.616)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	European High Yield Bond		European Sustainable Equity	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	EUR	EUR	EUR	EUR
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	2.425.341	215.121	–	–
Unternehmensanleihen	384.433.736	32.065.000	–	–
Aktien	–	–	171.225.790	174.388.827
Mittelfristige Schuldverschreibungen	114.727	202.519	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	643.091	1.258.544	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	18.355	–	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	387.635.250	33.741.184	171.225.790	174.388.827
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(1.281.452)	(3.113.019)	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(1.281.452)	(3.113.019)	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Event Driven[2]		Global Bond	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Agency Bonds	–	–	1.146.538	2.423.190
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	–	10.864.506	8.861.707
Unternehmensanleihen	–	–	28.855.602	44.359.194
Staatsanleihen	–	–	42.481.574	53.670.009
Mortgage-Backed Securities	–	–	22.645.649	19.062.981
Kommunalanleihen	–	–	1.278.776	1.706.806
Schatzwechsel	115.039.719	33.823.354	–	791.814
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	–	–	440.690	270.257
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	4.057.943	918.069	3.337.129	2.638.428
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	–	124.708	1.233
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	959.529	18.364	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	120.057.191	34.759.787	111.175.172	133.785.619
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	–	–	(622.972)	(191.230)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(155.365)	(18.616)	(3.195.228)	(1.908.377)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	–	(72.291)	(13.185)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(155.365)	(18.616)	(3.890.491)	(2.112.792)

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Global Diversified Income FMP – 2024		Global Equity Megatrends	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Unternehmensanleihen	123.463.985	150.336.737	–	–
Aktien	–	–	141.492.601	79.465.335
Staatsanleihen	1.727.993	3.931.136	–	–
Schatzwechsel	18.765.889	–	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	281.732	523.987	444	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	144.239.599	154.791.860	141.493.045	79.465.335
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(417)	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	–	(417)	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Global Flexible Credit Income		Global SDG Engagement	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	23.118.219	24.079.041	–	–
Unternehmensanleihen	296.273.462	316.164.124	532.499.481	273.005.334
Aktien	6.022.083	5.247.334	–	–
Staatsanleihen	15.379.748	9.817.787	–	–
Investmentfonds	66.832	338.564	–	–
Mittelfristige Schuldverschreibungen	15.105.874	–	4.933	1.013.476
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	3.733.739	468.202	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	8.130.820	29.033.515	11.935.674	12.873.530
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	268.263	–	–	13.411
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	368.099.040	385.148.567	544.440.088	286.905.751
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(5.173.223)	(515.955)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(3.447.658)	(10.857.921)	(6.738.234)	(9.426.254)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(632.100)	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(8.620.881)	(12.005.976)	(6.738.234)	(9.426.254)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Global High Yield Sustainable Action*		Global Investment Grade Credit	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Unternehmensanleihen	–	14.443.671	81.376.321	80.767.363
Staatsanleihen	–	–	2.082.454	2.758.010
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	95.881	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	7.620	1.115	16.124
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	–	14.547.172	83.459.890	83.541.497
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(358.029)	(1.107.450)	(1.642.819)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	–	(358.029)	(1.107.450)	(1.642.819)

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Global Opportunistic Bond		Global Real Estate Securities	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Agency Bonds	–	307.820	–	–
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	1.817.743	4.290.102	–	–
Unternehmensanleihen	27.412.055	35.431.699	–	–
Aktien	–	–	3.015.990	6.846.055
Staatsanleihen	21.133.383	24.711.043	–	–
Investmentfonds	21.165	1.801.216	–	–
Mortgage-Backed Securities	14.565.802	10.458.233	–	–
Immobilienaktiengesellschaften	–	–	17.071.668	30.360.798
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	839.044	568.616	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	4.673.609	2.069.747	422.478	866.015
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	193.716	455.060	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	76	17.416	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	70.656.593	80.110.952	20.510.136	38.072.868
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(356.573)	(607.164)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(6.577.836)	(4.857.533)	(250.684)	(147.763)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	(821.571)	(64.729)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	(27)	(141)	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(7.756.007)	(5.529.567)	(250.684)	(147.763)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Global Sustainable Equity		Global Sustainable Value	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Aktien	153.603.419	130.524.482	53.809.071	46.960.389
Immobilienaktiengesellschaften	–	–	1.116.404	755.437
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	–	66.448	125.312
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	153.603.419	130.524.482	54.991.923	47.841.138
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	–	(46.897)	(90.456)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	–	–	(46.897)	(90.456)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	High Yield Bond		InnovAsia 5G	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	10.897.982	21.830.306	–	–
Unternehmensanleihen	1.999.177.351	1.982.553.426	–	–
Aktien	–	–	22.524.887	13.872.508
Staatsanleihen	36.225.768	–	–	–
Investmentfonds	3.611.285	18.294.706	–	–
Mittelfristige Schuldverschreibungen	43.084.058	91.635.501	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	40.709.223	55.707.544	299.135	453.339
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	2.133.705.667	2.170.021.483	22.824.022	14.325.847
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(15.391.406)	(25.192.706)	(60.136)	(78.732)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	(51.928)	(404.963)	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(15.443.334)	(25.597.669)	(60.136)	(78.732)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Japan Equity Engagement		Macro Opportunities FX	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	JPY	JPY	EUR	EUR
Unternehmensanleihen	–	–	–	24.967.521
Aktien	15.961.893.000	20.207.455.300	–	–
Staatsanleihen	–	–	347.166	2.778.639
Schatzwechsel	–	–	2.407.376	4.389.983
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	128.484.079	44.531.344	4.627.295	3.617.207
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	16.090.377.079	20.251.986.644	7.381.837	35.753.350
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(42.002.252)	(141.215.249)	(4.613.695)	(4.428.576)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(42.002.252)	(141.215.249)	(4.613.695)	(4.428.576)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Multi-Asset Income*		Next Generation Mobility	
	Zum 31. Dezember 2023 Zeitwert	Zum 31. Dezember 2022 Zeitwert	Zum 31. Dezember 2023 Zeitwert	Zum 31. Dezember 2022 Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Agency Bonds	–	7.644	–	–
Unternehmensanleihen	–	4.880.908	–	–
Aktien	–	2.848.448	151.194.636	136.877.785
Staatsanleihen	–	311.601	–	–
Investmentfonds	–	602.185	–	–
Immobilienaktiengesellschaften	–	364.808	1.619.728	1.522.531
Gekaufte Optionskontrakte	–	4.207	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	–	51.032	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	160.435	20.789	294.328
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	–	9.231.268	152.835.153	138.694.644
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Verkaufte Optionskontrakte	–	(59.717)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	–	(2.994)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(584.335)	(10.365)	(213.661)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	–	(647.046)	(10.365)	(213.661)

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Next Generation Space Economy[2]		Responsible Asian Debt - Hard Currency	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Unternehmensanleihen	–	–	45.692.223	18.090.069
Aktien	18.674.716	7.981.674	–	–
Staatsanleihen	–	–	12.025.196	2.090.986
Schatzwechsel	–	–	2.496.736	–
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	–	–	255.858	47.079
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	–	127.055	34.382
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	–	575	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	18.674.716	7.981.674	60.597.643	20.262.516
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	–	–	(128.113)	(3.440)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	–	(135.330)	(84.733)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	–	(21)	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	–	–	(263.464)	(88.173)

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Short Duration Emerging Market Debt		Short Duration High Yield SDG Engagement	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Unternehmensanleihen	2.406.487.373	3.527.685.607	664.013.737	477.638.711
Staatsanleihen	1.307.631.941	1.205.827.702	–	–
Investmentfonds	49.810.000	70.347.000	241.028	1.221.039
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	–	13.420.047	23.578.927
Schatzwechsel	53.894.704	51.075.667	–	10.810.063
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	64.552.046	46.700.064	15.254.920	23.012.144
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	3.882.376.064	4.901.636.040	692.929.732	536.260.884
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	–	(1.843.240)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(9.131.675)	(23.986.773)	(3.114.085)	(5.286.451)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(9.131.675)	(25.830.013)	(3.114.085)	(5.286.451)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Strategic Income		Sustainable Asia High Yield	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	Zeitwert US$	Zeitwert US$	Zeitwert US$	Zeitwert US$
Agency Bonds	781.434	772.053	–	–
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	211.031.917	105.467.359	–	–
Unternehmensanleihen	535.844.310	637.567.177	24.364.117	27.495.016
Aktien	22.512	–	–	–
Staatsanleihen	175.669.880	243.357.365	2.505.094	837.924
Investmentfonds	60.766.454	58.225.837	–	–
Mortgage-Backed Securities	918.338.562	346.893.475	–	–
Kommunalanleihen	12.918.823	20.744.098	–	–
Mittelfristige Schuldverschreibungen	429.819	579.804	–	–
Schatzwechsel	221.166.130	8.017.122	–	–
Gekaufte Swaptions	15.122	–	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	3.637.375	2.904.814	23.897	13.122
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	20.251.351	29.520.687	16.926	282.337
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	905.422	25.894	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	834.927	451.266	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	461.585	–	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	2.163.075.623	1.454.526.951	26.910.034	28.628.399

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Strategic Income (Fortsetzung)		Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(18.576.468)	(1.425.842)	(58.271)	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(5.513.615)	(7.161.491)	(496)	(29.229)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(97.587)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	(1.085.681)	(916.187)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(3.863.949)	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(25.175.764)	(13.465.056)	(58.767)	(29.229)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Sustainable Emerging Market Corporate Debt		Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Unternehmensanleihen	83.464.415	86.982.672	28.120.429	7.708.197
Staatsanleihen	7.168.384	4.401.408	387.681.779	136.106.159
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	27.031	49.937	7.590.987	2.512.729
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	1.906.675	853.222	8.781.301	1.237.337
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	–	–	53.826
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	92.566.505	92.287.239	432.174.496	147.618.248
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(236.161)	(7.617)	(3.655.629)	(46.430)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(235.957)	(134.345)	(2.051.066)	(862.058)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(472.118)	(141.962)	(5.706.695)	(908.488)

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Tactical Macro[1]	Ultra Short Term Euro Bond	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	EUR	EUR
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	90.687.160	72.343.961
Unternehmensanleihen	–	789.167.617	670.503.994
Staatsanleihen	–	75.386.047	56.450.113
Schatzwechsel	22.994.103	8.960.964	–
Gekaufte Optionskontrakte	359.299	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	8.973	509.420	9.402.701
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	67.331	235.719	232.108
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	531.378	9.296
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	23.429.706	965.478.305	808.942.173
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet			
Verkaufte Optionskontrakte	(197.253)	–	–
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(28.337)	(2.783.686)	(1.719.108)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(36.811)	(2.512.078)	(6.570.781)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(2.179.454)	(543.950)
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	(293.227)	–
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(248.422)	(1.735.988)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(262.401)	(8.016.867)	(10.569.827)

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Uncorrelated Strategies		Uncorrelated Trading[2]*	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Unternehmensanleihen	120.618.827	161.387.060	-	13.221.435
Aktien	77.292.452	135.368.028	-	16.089.324
Immobilienaktiengesellschaften	1.217.656	4.976.282	-	3.946.436
Participatory Notes	37.045	21.440	-	-
Staatsanleihen	38.964.571	4.218.750	-	-
Schatzwechsel	707.195.701	1.582.793.462	-	449.200.010
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	106.923.561	78.118.012	-	13.934.583
Gekaufte Optionskontrakte	283.236.382	202.760.196	-	35.858.570
Gekaufte Swaptions	40.202	1.388.392	-	68.848
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	18.420.818	40.643.851	-	8.521.839
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	91.871.867	212.294.005	-	54.485.356
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	3.395.463	3.899.449	-	678.244
Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten	379.911	700.944	-	-
Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten	3.828.212	971.550	-	319.127
Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten	18.426.175	32.121.676	-	1.343.255
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	3.727.082	65.682.162	-	1.024.404
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	-	27.160.802	-	-
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	686.246	1.435.658	-	-
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.476.262.171	2.555.941.719	-	598.691.431

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.
* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)		Uncorrelated Trading[2]* (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	Zeitwert US$	Zeitwert US$	Zeitwert US$	Zeitwert US$
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	(20.691.238)	(58.716.225)	-	(3.269.736)
Verkaufte Optionskontrakte	(378.717.224)	(309.983.118)	-	(42.460.180)
Verkaufte Swaptionen	(29.043)	(708.024)	-	(20.738)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(24.593.398)	(25.288.052)	-	(4.922.598)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(53.084.382)	(37.812.332)	-	(6.317.151)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	(9.089.737)	(23.945.145)	-	(1.000.582)
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	-	(26.861.904)	-	-
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	(1.305.860)	(526.998)	-	(47.926)
Nicht realisierter Verlust aus Correlation-Swap-Kontrakten	-	(60.576)	-	-
Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten	(514.676)	(421.247)	-	(332.219)
Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten	(8.911.489)	(4.417.825)	-	(939.941)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	(3.021.166)	(1.242.422)	-	(13.154)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(499.958.213)	(489.983.868)	-	(59.324.225)

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.
* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	US Equity		US Equity Index PutWrite	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Aktien	45.872.647	27.005.260	–	–
Staatsanleihen	–	–	663.357.136	632.264.076
Immobilienaktiengesellschaften	–	478.769	–	–
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	1.253.492	2.158.080	12.128.805	16.592.327
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	47.126.139	29.642.109	675.485.941	648.856.403
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Verkaufte Optionskontrakte	–	–	(5.251.795)	(12.932.325)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(118.963)	(546.931)	(538.104)	(1.350.871)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(118.963)	(546.931)	(5.789.899)	(14.283.196)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	US Large Cap Value		US Long Short Equity	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Unternehmensanleihen	–	–	7.670.535	8.400.448
Aktien	1.847.675.317	1.688.625.847	166.583.403	158.010.330
Participatory Notes	–	–	–	3.750
Immobilienaktiengesellschaften	3.901.309	–	3.534.047	1.744.930
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	–	487.831	–
Differenzkontrakte	–	–	624.429	3.162.728
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	–	–	–	470.254
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	1.119.012	973.737	3.283.704	6.686.844
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	–	–	664.406
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.852.695.638	1.689.599.584	182.183.949	179.143.690
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Differenzkontrakte	–	–	(2.740.096)	(1.291.811)
Verkaufte Optionskontrakte	–	–	(15.714)	(74.360)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	–	–	(1.003.428)	–
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(115.827)	(102.612)	(342.870)	(822.791)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	–	(4.635.993)	(700.901)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(115.827)	(102.612)	(8.738.101)	(2.889.863)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	US Multi Cap Opportunities		US Real Estate Securities	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Aktien	396.982.739	439.025.865	–	–
Immobilienaktiengesellschaften	–	–	519.992.632	624.531.489
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	1.843.892	2.736.142	2.358.847	4.089.640
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	398.826.631	441.762.007	522.351.479	628.621.129
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(325.170)	(587.402)	(441.683)	(1.230.032)
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(325.170)	(587.402)	(441.683)	(1.230.032)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

2. FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN, ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTET (FORTSETZUNG)

	US Small Cap		US Small Cap Intrinsic Value	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert	Zeitwert
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	US$	US$	US$	US$
Aktien	622.291.910	578.779.674	299.826.372	184.718.734
Immobilienaktiengesellschaften	–	–	1.910.421	2.170.638
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	747.370	949.457	–	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	623.039.280	579.729.131	301.736.793	186.889.372
Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	(137.144)	(236.699)	(398)	–
Gesamtwert der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	(137.144)	(236.699)	(398)	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE

Alle Kassenbestände werden bei Brown Brothers Harriman & Co. oder bei vom Fonds genehmigten Drittinstituten als Tagesgeldeinlagen oder direkt bei einer Unterdepotbank gehalten. In den nachfolgenden Tabellen ist das Risiko aufgeführt, dem der Fonds durch die aufgeführten Institute mit seinen Bareinlagen am 31. Dezember 2023 und am 31. Dezember 2022 ausgesetzt war.

	5G Connectivity		Absolute Return Multi Strategy*		China A-Share Equity	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
ANZ Bank, Hong Kong	-	-	-	-	10.286	-
ANZ Bank, London	-	5	7.009	3.884	-	-
Bank of Montreal, London	-	-	7.012	-	-	-
Bank of Nova Scotia, Toronto	-	-	7.009	3.884	-	-
BBH, Grand Cayman	-	2	-	63.136	-	-
BBH, New York	-	-	42.344	-	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	194.032	95.330	425	337	1.064.042	947.616
Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto	-	-	-	-	-	-
Citibank, New York	43.447.745	34.022.865	7.012	2.651	-	-
DNB, Oslo	-	-	6	-	-	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	601	402	-	-	-	4.836
HSBC Bank Plc, London	5	-	-	-	-	-
JPMorgan Chase, New York	-	-	7.009	3.884	-	478
National Australia Bank, London	-	-	-	3.751	-	-
Royal Bank of Canada, Toronto	-	-	7.012	3.884	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	-	7.009	3.884	-	-
Sumitomo, Tokyo	1.479	1.050	7.012	3.884	517	-
Insgesamt	**43.643.862**	**34.119.654**	**98.859**	**93.179**	**1.074.845**	**952.930**

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	China Bond		China Equity		Climate Innovation[1]	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	CNY	CNY	CNY	CNY	US$	US$
ANZ Bank, Hong Kong	-	-	-	-	2	-
Bank of Montreal, London	4.780.550	-	-	-	-	-
BBH, Grand Cayman	-	4	-	-	-	-
BBH, New York	4	-	-	-	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	4.665.103	22.349.396	2.865.781	2.089.537	364	-
Citibank, New York	-	437.578	-	346.391	83.482	-
DNB, Oslo	-	-	-	-	27	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	-	-	2.907.393	6.109.128	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	954	-	244.016	-	-	-
Sumitomo, Tokyo	-	1.979	-	-	-	-
Insgesamt	**9.446.611**	**22.788.957**	**6.017.190**	**8.545.056**	**83.875**	**-**

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	CLO Income		Commodities[2]		Corporate Hybrid Bond	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	EUR	EUR
Bank of Montreal, London	-	-	684.552	-	-	-
Barclays Bank, London	-	-	-	-	-	21.252.082
BBH, Grand Cayman	-	-	-	-	-	1
Brown Brothers Harriman & Co	51.817	44.379	92.067	46.258	342.084	297.452
Citibank, New York	12.233.975	9.657.697	10.810.004	5.975.120	39.076.989	-
DNB, Oslo	-	-	-	-	1.341.143	-
HSBC Bank Plc, London	-	-	-	-	38.663.608	-
JPMorgan Chase, New York	-	984.125	10.810.004	-	-	83.168.999
Royal Bank of Canada, Toronto	-	-	-	2.073.620	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	9.657.697	-	-	-	-
Sumitomo, Tokyo	1.418	5.897	10.810.004	-	-	20.246.629
Insgesamt	**12.287.210**	**20.349.795**	**33.206.631**	**8.094.998**	**79.423.824**	**124.965.163**

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Developed Market FMP – 2027[1]		Emerging Market Debt - Hard Currency		Emerging Market Debt - Local Currency	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Bank of Nova Scotia, Toronto	-	-	-	17.655.809	839	788
Barclays Bank, London	-	-	29	-	-	-
BBH, Grand Cayman	-	-	-	1	-	-
BNP Paribas, Paris	-	-	16	-	-	379
Brown Brothers Harriman & Co	1.653	-	8.540	285.028	1.021.127	1.999.950
Citibank, New York	-	-	-	-	-	10.175.191
DNB, Oslo	-	-	2.297.690	-	2	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	-	-	-	-	2	225.273
HSBC Bank Plc, London	-	-	-	-	-	4
JPMorgan Chase, New York	501.784	-	-	-	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	-	-	-	4	-
Sumitomo, Tokyo	-	-	-	89.983.319	33.877.656	-
Insgesamt	**503.437**	**-**	**2.306.275**	**107.924.157**	**34.899.630**	**12.401.585**

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Emerging Market Debt Blend		Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend		Emerging Markets Equity	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
ANZ Bank, London	-	3.598	-	-	-	24
ANZ Bank, Hong Kong	-	-	-	-	571	-
Bank of Nova Scotia, Toronto	279	262	2	1	6.154	15.773
BBH, Grand Cayman	-	1	-	-	-	-
BNP Paribas, Paris	28	421.660	-	-	267	231
Brown Brothers Harriman & Co	412.150	838.790	33.259	49.801	375.937	190.441
Credit Suisse AG, Zurich	-	25	-	-	-	-
DNB, Oslo	-	-	-	-	3	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	2	168.430	-	-	2	355
JPMorgan Chase, New York	-	1.367.719	-	3.167.510	-	5.149.468
Nordea Bank, Oslo	-	-	7	7	-	-
Royal Bank of Canada, Toronto	14.175.872	-	-	-	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	3.946	-	2.600.660	-	2.913.245	-
Sumitomo, Tokyo	503.538	1.234.517	120.150	195.752	3	3
Insgesamt	**15.095.815**	**4.035.002**	**2.754.078**	**3.413.071**	**3.296.182**	**5.356.295**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Emerging Markets Select Equity*		Euro Bond		Euro Bond Absolute Return	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	EUR	EUR
ANZ Bank, London	7.479	-	-	-	-	-
Bank of Montreal, London	7.479	-	-	-	-	-
Bank of Nova Scotia, Toronto	7.479	7	-	-	-	-
BBH, Grand Cayman	-	2	-	-	-	-
BBH, New York	99.428	-	-	-	-	-
BNP Paribas, Paris	-	77	-	-	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	4.706	56.551	447	145	1.384	1.052
Citibank, London	-	-	-	473.003	72.050	-
Citibank, New York	7.479	-	-	-	27.840	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	6	484	-	-	-	-
JPMorgan Chase, New York	7.479	3.345.805	-	-	-	-
Royal Bank of Canada, Toronto	7.479	-	-	-	-	15.670
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	7.479	-	-	-	359.043	-
Sumitomo, Tokyo	7.479	5	127.229	-	-	1.694.020
Insgesamt	**163.972**	**3.402.931**	**127.676**	**473.148**	**460.317**	**1.710.742**

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	European High Yield Bond		European Sustainable Equity		Event Driven[2]	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	EUR	EUR	EUR	EUR	US$	US$
ANZ Bank, London	-	-	-	24	-	1.047.071
BBH, Grand Cayman	-	-	-	10	-	-
BNP Paribas, Paris	-	-	121	-	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	56.985	3.356	2.807	451	46.874	21.102
Citibank, New York	-	-	-	-	8.836.292	2.901.931
Credit Suisse AG, Zurich	-	-	-	23	-	-
DNB, Oslo	-	-	101	-	-	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	1	1	-	-	-	-
HSBC Bank Plc, London	-	-	-	-	2.014	1.928
JPMorgan Chase, New York	-	-	-	-	4.614.996	2.901.931
Nordea Bank, Oslo	-	-	-	22	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	419.586	143	37	-	-
Sumitomo, Tokyo	16.567.542	949.253	1.124.096	1.487.045	-	-
Insgesamt	**16.624.528**	**1.372.196**	**1.127.268**	**1.487.612**	**13.500.176**	**6.873.963**

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Global Bond		Global Diversified Income FMP – 2024		Global Equity Megatrends	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
ANZ Bank, Hong Kong	5.105	-	-	-	-	-
ANZ Bank, London	-	4.997	-	5.320.556	-	-
Bank of Nova Scotia, Toronto	292.499	299.876	-	11.223.942	31	6
BNP Paribas, Paris	720	7.075	-	-	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	11.337	85.599	24.299	32.667	10.664	660
Citibank, New York	-	-	10.930.286	11.223.942	-	-
DNB, Oslo	4.233	-	-	-	-	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	-	15.786	-	-	-	-
HSBC Bank Plc, London	-	-	-	-	54	-
JPMorgan Chase, New York	737.217	-	72.364	-	-	-
MUFG Bank, Tokyo	6.259	21.208	-	-	-	-
Nordea Bank, Oslo	35	52	-	-	-	-
Royal Bank of Canada, Toronto	-	2.702.169	-	11.223.942	-	77.062
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	25.934	685	-	-	-	4
Sumitomo, Tokyo	78.733	1.562.643	-	11.223.942	5.251.653	-
Insgesamt	**1.162.072**	**4.700.090**	**11.026.949**	**50.248.991**	**5.262.402**	**77.732**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Global Flexible Credit Income		Global SDG Engagement		Global High Yield Sustainable Action*	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
ANZ Bank, London	-	681.475	-	-	1.059	915.917
Bank of Montreal, London	-	-	-	-	1.060	-
Bank of Nova Scotia, Toronto	792	744	-	-	1.060	-
Barclays Bank, London	-	-	-	-	220	-
BBH, New York	-	-	-	-	42.897	-
BNP Paribas, Paris	-	-	1.176	-	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	53.406	45.556	48.339	20.691	222	1.253
Citibank, New York	-	-	-	-	1.060	-
DNB, Oslo	-	-	-	-	500	-
HSBC Bank Plc, London	-	-	-	1.146	-	-
JPMorgan Chase, New York	-	8.843.449	-	4.833.186	1.060	-
Royal Bank of Canada, Toronto	-	-	-	-	1.060	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	327.014	-	394.203	-	1.060	13.904
Sumitomo, Tokyo	25.100.882	547.637	10.265.487	404.491	1.060	102.147
Insgesamt	**25.482.094**	**10.118.861**	**10.709.205**	**5.259.514**	**52.318**	**1.033.221**

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Global Investment Grade Credit		Global Opportunistic Bond		Global Real Estate Securities	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
ANZ Bank, Hong Kong	-	-	-	-	5.841	-
ANZ Bank, London	-	-	15.142	1.160	-	9
Bank of Nova Scotia, Toronto	69	331.728	3.929	1.451	195	916
BNP Paribas, Paris	-	-	5.414	31.700	26	-
Brown Brothers Harriman & Co	12.902	5.658	214.704	114.657	1.744	3.184
DNB, Oslo	-	-	5.788	-	2.409	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	-	-	-	-	-	16.142
HSBC Bank Plc, London	1.198.923	-	-	-	-	-
JPMorgan Chase, New York	-	-	-	5.157.636	-	1.102.718
MUFG Bank, Tokyo	-	-	26.850	-	-	-
Royal Bank of Canada, Toronto	2.075.370	1.647.409	-	-	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	-	147.654	291.327	67	-
Sumitomo, Tokyo	114.199	1.580.436	1.109.973	265.332	201.367	2.272
Insgesamt	**3.401.463**	**3.565.231**	**1.529.454**	**5.863.263**	**211.649**	**1.125.241**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Global Sustainable Equity		Global Sustainable Value		High Yield Bond	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$		US$		US$	
ANZ Bank, Hong Kong	-	-	36	-	-	-
ANZ Bank, London	-	-	26	1.176	-	-
Bank of Nova Scotia, Toronto	-	-	1.931	1.980	-	-
Barclays Bank, London	90	-	-	-	-	10.543.050
BBH, Grand Cayman	-	5	-	120	-	-
BNP Paribas, Paris	17	-	222	40	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	4.806	4.994	7.891	8.161	158.989	388.523
Citibank, London	-	-	-	-	-	61.521
Citibank, New York	775.000	-	-	-	-	-
Credit Suisse AG, Zurich	-	6	-	-	-	-
DNB, Oslo	85	-	2	-	-	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	-	-	-	25	-	-
JPMorgan Chase, New York	-	1.064.594	-	-	73.453.680	123.483.341
MUFG Bank, Tokyo	-	-	-	3	-	-
Nordea Bank, Oslo	946	945	100	18	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	60	534.728	-	-	-
Sumitomo, Tokyo	226	110	-	715.983	5.263	-
Insgesamt	**781.170**	**1.070.714**	**544.936**	**727.506**	**73.617.932**	**134.476.435**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	InnovAsia 5G		Japan Equity Engagement		Macro Opportunities FX	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	JPY	JPY	EUR	EUR
Bank of Montreal, London	-	-	-	-	32.952	-
Barclays Bank, London	-	-	-	-	21	-
BBH, Grand Cayman	-	1	-	-	-	-
BNP Paribas, Paris	6	-	-	-	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	10.719	2.479	-	-	242	141
Citibank, New York	1.118.218	-	-	-	-	912
HSBC Bank Plc, Hong Kong	-	4	-	-	-	-
MUFG Bank, Tokyo	-	-	90.965.141	421.921.338	-	-
Royal Bank of Canada, Toronto	-	593.850	-	-	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	-	-	-	93.660	20
Sumitomo, Tokyo	-	2	-	-	-	130.034
Insgesamt	**1.128.943**	**596.336**	**90.965.141**	**421.921.338**	**126.875**	**131.107**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Multi-Asset Income*		Next Generation Mobility		Next Generation Space Economy[2]	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
ANZ Bank, London	-	27.772	2	9.687.021	-	-
Bank of Nova Scotia, Toronto	-	9	58.961	-	-	-
BBH, Grand Cayman	-	1	-	-	-	1
BNP Paribas, Paris	-	198	-	-	3	-
Brown Brothers Harriman & Co	58.916	25.216	44.850	30.352	2.565	1.598
Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto	-	-	-	-	-	-
Citibank, New York	-	-	11.585.167	-	940.668	-
Credit Suisse AG, Zurich	-	8	-	-	-	-
DNB, Oslo	-	-	9	-	-	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	-	466	12	9	-	-
HSBC Bank Plc, London	-	-	-	-	6	-
JPMorgan Chase, New York	-	663.587	-	-	-	-
MUFG Bank, Tokyo	-	46.385	-	-	-	-
Nordea Bank, Oslo	-	30	-	-	-	-
Royal Bank of Canada, London	-	-	57	-	-	-
Royal Bank of Canada, Toronto	-	436.998	-	-	-	553.649
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	84.600	2	1	-	-
Sumitomo, Tokyo	-	510.051	-	-	46	26
Insgesamt	**58.916**	**1.795.321**	**11.689.060**	**9.717.383**	**943.288**	**555.274**

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.
* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Responsible Asian Debt – Hard Currency		Short Duration Emerging Market Debt		Short Duration High Yield SDG Engagement	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
ANZ Bank, London	-	-	-	191	-	-
Barclays Bank, London	-	-	-	-	2.665.526	-
BNP Paribas, Paris	-	-	-	-	395	399
Brown Brothers Harriman & Co	85.097	6.508	76.426	447.514	151.589	84.117
Citibank, New York	2.623.771	1.173.705	9.105.400	158.792.223	41.651.733	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	-	-	-	-	3	5
JPMorgan Chase, New York	-	-	-	-	-	26.512.099
MUFG Bank, Tokyo	-	-	4	-	10	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	-	-	-	-	1.257.126
Sumitomo, Tokyo	-	48	5.076.125	37.315.688	-	12
Insgesamt	**2.708.868**	**1.180.261**	**14.257.955**	**196.555.616**	**44.469.256**	**27.853.758**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Strategic Income		Sustainable Asia High Yield		Sustainable Emerging Market Corporate Debt	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
ANZ Bank, Hong Kong	134	-	-	-	-	-
ANZ Bank, London	-	40	-	-	-	-
Bank of Nova Scotia, Toronto	51.500.431	340.990	-	-	-	-
BNP Paribas, Paris	1.815.812	1.835.401	-	-	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	342.923	514.071	5.263	7.098	131.390	172.843
Citibank, New York	-	92.478.753	1.155.619	-	-	-
DNB, Oslo	41	-	-	-	-	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	-	25	-	-	-	-
HSBC Bank Plc, London	216.020	-	-	-	-	-
JPMorgan Chase, New York	-	6.265.751	-	-	-	-
Nordea Bank, Oslo	5.343	5.386	-	-	-	-
Royal Bank of Canada, Toronto	-	-	-	2.228.125	-	6.780.260
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	-	-	-	6	-
Sumitomo, Tokyo	1.324.930	3.538.083	2.195	534.967	3.844.875	6
Insgesamt	**55.205.634**	**104.978.500**	**1.163.077**	**2.770.190**	**3.976.271**	**6.953.109**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]		Tactical Macro[1]		Ultra Short Term Euro Bond	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	EUR	EUR
Bank of Nova Scotia, Toronto	4.604.889	-	-	-	-	-
BNP Paribas, Paris	-	-	148	-	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	1.117	21.151	37.013	-	26.934	26.816
Citibank, New York	-	-	1.541.601	-	94.551	-
JPMorgan Chase, New York	-	-	1.893.496	-	-	93.584
MUFG Bank, Tokyo	-	-	753	-	-	-
Nordea Bank, Oslo	-	-	4	-	-	-
Royal Bank of Canada, London	-	-	43.619	-	11.093.807	-
Royal Bank of Canada, Toronto	-	8.131.270	-	-	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	-	37.666	-	7.280	-
Sumitomo, Tokyo	2.436.526	472.775	-	-	-	9.919.073
Insgesamt	**7.042.532**	**8.625.196**	**3.554.300**	**-**	**11.222.572**	**10.039.473**

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	Uncorrelated Strategies		Uncorrelated Trading[2]*		US Equity	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
ANZ Bank, Hong Kong	218.464	-	-	-	-	-
ANZ Bank, London	952.642	10.278.374	-	2.633.103	-	-
Bank of Montreal, London	8.552.039	-	-	-	-	-
Bank of Nova Scotia, Toronto	4.626.950	4.692.746	-	716.044	-	-
Barclays Bank, London	92.899	1.461	-	-	-	-
BBH, Grand Cayman	-	1.671	-	120	-	-
BBH, New York	92.993	-	-	-	-	-
BNP Paribas, Paris	3.060.417	1.551.615	-	3.110.791	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	2.270.350	6.239.065	198.922	171.782	9.332	7.205
Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto	-	-	-	-	-	-
Citibank, London	2.621.204	7.014	-	1.636.196	-	-
Citibank, New York	92.203.361	29.580.967	-	4.245.695	-	-
Credit Suisse AG, Zurich	-	289.893	-	12.219	-	-
DNB, Oslo	4.926.275	-	-	-	-	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	1.359.612	425.640	-	2.290	-	-
HSBC Bank Plc, London	1.282.249	511	-	155.949	-	-
JPMorgan Chase, New York	40.362.701	122.010.499	-	4.125.371	-	-
MUFG Bank, Tokyo	110.182	11.879	-	175.896	-	-
National Australia Bank, London	-	2.399.742	-	-	-	191.583
Nordea Bank, Oslo	151.618	1.487	-	11	-	-
Royal Bank of Canada, London	618.592	-	-	-	-	-
Royal Bank of Canada, Toronto	15.475.809	59.244.394	-	31.631.227	-	-
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	11.432.447	8.513.551	-	2.585.640	2.307.738	-
Sumitomo, Tokyo	25.584.764	55.896.809	-	15.006.166	-	2.196.478
Insgesamt	**215.995.568**	**301.147.318**	**198.922**	**66.208.500**	**2.317.070**	**2.395.266**

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.
* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	US Equity Index PutWrite		US Large Cap Value		US Long Short Equity	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Bank of Montreal, London	-	-	-	-	4.906.575	-
BBH, New York	-	-	-	-	1	-
BNP Paribas, Paris	-	-	-	-	14	-
Brown Brothers Harriman & Co	269.501	157.884	366.677	140.298	16.317	98.659
Citibank, New York	-	-	122.081.772	-	-	-
Credit Suisse AG, Zurich	-	-	-	-	-	11
HSBC Bank Plc, Hong Kong	147	141	-	-	-	2
JPMorgan Chase, New York	-	-	-	-	-	15.573.911
Royal Bank of Canada, London	-	-	-	-	3.995	-
Royal Bank of Canada, Toronto	4.824.800	-	-	75.057.821	-	3.197.677
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	3	-	7.038.957	-	-	-
Sumitomo, Tokyo	51.076.090	44.333.902	6	4	-	15.573.911
Insgesamt	**56.170.541**	**44.491.927**	**129.487.412**	**75.198.123**	**4.926.902**	**34.444.171**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	US Multi Cap Opportunities		US Real Estate Securities		US Small Cap	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
ANZ Bank, London	-	4	847	821	3	26.133
Bank of Montreal, London	-	-	12.777.934	-	-	-
Bank of Nova Scotia, Toronto	-	-	-	-	13.163	12.365
Barclays Bank, London	-	-	-	-	28.653	-
BBH, Grand Cayman	-	-	-	1	-	-
BNP Paribas, Paris	5	5	-	-	-	-
Brown Brothers Harriman & Co	6.078	5.734	45.962	59.573	28.003	48.019
Citibank, London	-	-	-	-	-	2
DNB, Oslo	6	-	-	-	-	-
HSBC Bank Plc, Hong Kong	2	3	-	-	-	-
Royal Bank of Canada, Toronto	2.014.851	1.253.428	-	21.823.790	-	10.588.172
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	-	6	-	12.674.878	-
Sumitomo, Tokyo	-	-	-	5	3	-
Insgesamt	**2.020.942**	**1.259.174**	**12.824.749**	**21.884.190**	**12.744.703**	**10.674.691**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

3. BARMITTEL UND BARMITTELÄQUIVALENTE (FORTSETZUNG)

	US Small Cap Intrinsic Value	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$
Brown Brothers Harriman & Co	92.397	31.273
Skandinaviska Enskilda Banken, Stockholm	-	8.808.823
Sumitomo, Tokyo	18.206.721	-
Insgesamt	**18.299.118**	**8.840.096**

Entsprechend den Leitlinien der Central Bank of Ireland mit dem Titel „Umbrella Funds – Cash Accounts Holding Subscription, Redemption and Dividend Monies" (Kassenbestände mit Zeichnungs-, Rücknahme- und Ausschüttungsgeldern), die im März 2016 herausgegeben wurden, werden eines oder mehrere Konten für die Kassenbestände des Fonds in Übereinstimmung mit den Anforderungen der CBI von der Verwaltungsstelle im Auftrag des Fonds gehalten. Derlei Konten für Kassenbestände sind dazu gedacht, nicht abgewickelte Zeichnungsgelder von Anlegern, an Anleger zahlbare Rücknahmegelder und/oder sonstige an Anleger fällige Beträge zu halten. Zum 31. Dezember 2023 beliefen sich die Gelder in diesen Konten auf 331.887 US$ (31. Dezember 2022: 1.424.081 US$). Jegliche zum Ende des Geschäftsjahres auf diesen Barkonten gehaltenen Gelder werden in den Gesamtbilanzen des Fonds ausgewiesen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

4. KONTENÜBERZIEHUNG

Per 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 werden alle in der Bilanz ausgewiesenen Überziehungskredite bei Brown Brothers Harriman & Co. gehalten.

5. ANTEILKAPITAL

Das genehmigte Anteilkapital des Fonds beträgt 500.000.040.000 nennwertlose Anteile und besteht aus 40.000 Zeichneranteilen ohne Nennwert sowie 500.000.000.000 gewinnberechtigten Anteilen ohne Nennwert. Die Direktoren sind befugt, bis zu 500.000.000.000 nennwertlose Anteile des Fonds zu den von ihnen für geeignet erachteten Konditionen auszugeben.

Der Fonds ist aufgrund seiner Fähigkeit, Anteile auf Aufforderung auszugeben und zurückzunehmen, eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital. Das Anteilskapital des Fonds ist in verschiedene Anteilsserien aufgeteilt, wobei jede Anteilsserie ein separates Investmentportfolio mit Vermögenswerten darstellt. Die Portfolios verwalten Kapital in Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften und den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die für solch ein Portfolio gelten und im vorliegenden Prospekt und jeweiligen Nachtrag des Portfolios festgelegt sind. Die Portfolios unterliegen keinen extern vorgeschriebenen Kapitalerfordernissen. Während die Portfolios in übertragbare Wertpapiere und andere liquide Finanzanlagen investieren, verfolgt der Manager auch einen angemessenen Prozess zur Überwachung des Liquiditätsrisikos, der die von den Portfolios eingesetzten Transaktionen für ein effizientes Portfoliomanagement berücksichtigt, um sicherzustellen, dass jedes Portfolio in der Lage ist, die angegebenen Bedingungen bei Anteilsrücknahmen zu erfüllen.

Um potenzielle Liquiditätsrisiken zu mindern, passt der Manager seine Kontrollen an die verschiedenen Anlagestrategien, Liquiditätsbedingungen und das Kundenverhalten in der Vergangenheit an. Als Teil der Risikoüberwachung kann der Manager auf verschiedene Liquiditätstests zurückgreifen, deren Ergebnisse zahlreiche Lösungen bedingen können, darunter eine Anpassung der Zusammensetzung der Vermögenswerte, die Inanspruchnahme von Überziehungs- oder Kreditfazilitäten oder anderer geeignete Maßnahmen, um ein hinlängliches Liquiditätsniveau sicherzustellen. Alle Vereinbarungen auf Portfolioebene werden von der Risikofunktion des Managers, den Portfoliomanagern des betreffenden Portfolios, dem Chief Investment Officer des Managers sowie den Direktoren des Managers und den Direktoren der Gesellschaft überprüft. Das Risikoteam des Managers führt regelmäßig Portfoliostresstests im Kontext der Zusammensetzung des jeweiligen Portfolios und der aktuellen/potenziellen Marktbedingungen durch. Dabei werden Stressszenarien mit verschiedenen hypothetischen Rücknahmeniveaus durchgespielt und die Fähigkeit der Portfolios bewertet, Rücknahmeanträge auf diesen Niveaus auf ordnungsgemäße Weise zu erfüllen. Sollte die Analyse ergeben, dass eines der Portfolios eine niedrige Liquiditätsdeckungsquote aufweist, werden Rücksprachen seitens des Risikoteams des Managers und des Portfolioteams gehalten und relevante Schritte unternommen, um die damit verbundenen Risiken zu bewerten und auf bestmögliche Weise zu verringern. Ferner werden auf Tagesbasis die Liquiditätspuffer im Rahmen der Berichterstattung überwacht, um das Liquiditätsrisiko eines jeden Portfolios zu erfassen. Abgesehen davon werden die Marktliquidität betreffende Faktoren überwacht, um diesbezügliche potenzielle Anomalien zu erfassen.

Am 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 waren 2 Zeichneranteile ausgegeben. Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber zur Teilnahme und Abstimmung auf Hauptversammlungen des Fonds, berechtigen die Inhaber jedoch nicht am Gewinn oder am Vermögen des Fonds zu partizipieren, mit Ausnahme einer Kapitalrückzahlung im Falle einer Liquidation. Die gewinnberechtigten Anteile ermächtigen die Inhaber zur Teilnahme und Stimmabgabe bei Hauptversammlungen des Fonds sowie zur Beteiligung an den Gewinnen und den Vermögenswerten des Fonds.

Die Zeichneranteile werden wie folgt gehalten:

Name des Anteilinhabers	Anzahl der Anteile
Matsack Nominees Limited	1
Neuberger Berman Europe Limited	1

Die Mindestzeichnungs- und Rücknahmegrenzen für jeden Teilfonds finden sich im Verkaufsprospekt des Fonds.

Das Kapital der Portfolios wird durch das auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteilen entfallende Nettovermögen repräsentiert. Der Betrag des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens kann sich auf Monatsbasis erheblich ändern, da die Portfolios monatlichen Zeichnungen und Rücknahmen nach Ermessen der Anteilinhaber unterliegen.

Die Ziele der Portfolios für die Verwaltung des Kapitals sind:

- Das Kapital in Anlagen zu investieren, die den Anlagezielen, den Anlagepolitiken, dem Risiko und der erwarteten Rendite gemäß den Angaben im Verkaufsprospekt entsprechen;
- Erzielung von Renditen bei gleichzeitigem Kapitalschutz durch Anwendung der im Verkaufsprospekt angegebenen Anlagestrategien;
- Aufrechterhaltung einer ausreichenden Liquidität zur Begleichung der Ausgaben der Portfolios und um Rücknahmeanträge zu erfüllen, wenn sie entstehen; und
- Aufrechterhaltung einer ausreichenden Größe, um den Betrieb der Portfolios kosteneffizient zu gestalten.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Veränderung der Anzahl rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile im Geschäftsjahr:

5G Connectivity

	Thesaurierende Klasse AUD A	Thesaurierende Klasse AUD I2*	Thesaurierende Klasse CHF A*	Thesaurierende Klasse CHF I*	Thesaurierende Klasse CHF I2*	Thesaurierende Klasse CNY A	Thesaurierende Klasse CNY I2*	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.137.146	–	–	–	–	41.590	–	5.175.148	5.791.246	5.085.224
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	600.388	4.665	2.627	2.627	2.675	–	2.181	408.666	1.393.678	1.016.506
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(806.919)	–	–	–	–	(11.993)	–	(1.642.840)	(2.839.506)	(2.276.778)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.930.615	4.665	2.627	2.627	2.675	29.597	2.181	3.940.974	4.345.418	3.824.952
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.604.463	–	–	–	–	52.732	–	7.433.954	6.167.163	5.429.505
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	71.103	–	–	–	–	–	–	764.409	3.177.781	2.057.988
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(538.420)	–	–	–	–	(11.142)	–	(3.023.215)	(3.553.698)	(2.402.269)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.137.146	–	–	–	–	41.590	–	5.175.148	5.791.246	5.085.224

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I2*	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP A	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I2*	Thesaurierende Klasse HKD A	Thesaurierende Klasse HKD I2*	Thesaurierende Klasse SGD A
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	4.835.463	–	194.128	4.899.354	1.222.283	68.522	–	5.414.373	–	2.280.615
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.290.694	2.791	–	543.853	107.886	2.304	2.400	2.836.065	23.473	38.815
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.496.221)	–	(192.163)	(634.221)	(535.509)	(42.084)	–	(4.179.386)	–	(544.973)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.629.936	2.791	1.965	4.808.986	794.660	28.742	2.400	4.071.052	23.473	1.774.457
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.941.448	–	311.788	4.539.162	1.492.479	82.730	–	8.536.035	–	2.909.801
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.180.308	–	–	862.513	39.345	–	–	234.576	–	79.507
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.286.293)	–	(117.660)	(502.321)	(309.541)	(14.208)	–	(3.356.238)	–	(708.693)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.835.463	–	194.128	4.899.354	1.222.283	68.522	–	5.414.373	–	2.280.615

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse SGD I2*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD E*	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD I5	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	46.228.556	–	14.717.531	1.931.717	995.963	9.735.467	1.246.071	2.923.879	112.195
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.039	1.600.865	232.269	662.756	34.656	97.633	475.669	–	115.513	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(13.005.639)	(167.419)	(6.132.703)	(428.955)	(995.963)	(1.277.082)	(64.764)	(736.239)	(3.771)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.039	34.823.782	64.850	9.247.584	1.537.418	97.633	8.934.054	1.181.307	2.303.153	108.424
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	61.777.605	–	24.758.164	3.120.952	995.963	10.641.211	2.514.302	3.526.969	87.653
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	2.756.481	–	2.837.113	178.355	–	792.941	100.134	247.437	26.079
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(18.305.530)	–	(12.877.746)	(1.367.590)	–	(1.698.685)	(1.368.365)	(850.527)	(1.537)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	46.228.556	–	14.717.531	1.931.717	995.963	9.735.467	1.246.071	2.923.879	112.195

	Thesaurierende Klasse ZAR A*	Thesaurierende Klasse ZAR E*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr		
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	52.912	26.304
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(23.617)	(9.889)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	29.295	16.415

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China A-Share Equity

	Thesaurierende Klasse CNY I	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungs-gesichert)	Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungs-gesichert)
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.461	2.934	250.091
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.461	2.934	250.091
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.461	44.290	250.091
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	1.934	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(43.290)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.461	2.934	250.091

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China Bond

	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse CNY I	Thesaurierende Klasse CNY Z	Thesaurierende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse USD Z	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungs-gesichert)
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.993	2.348	1.832	–	–	2.176	68.293	563.515	4.953.693	1.215.396
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	10.621	10	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	(27.567)	(272.976)	(134.890)	(7.087)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.993	2.348	1.832	–	–	2.176	51.347	290.549	4.818.803	1.208.309
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.993	14.415	1.832	8.000	55.985	4.467	195.760	1.807.436	5.179.582	1.219.964
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	2.347	–	–	–	–	548.099	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(14.414)	–	(8.000)	(55.985)	(2.291)	(675.566)	(1.243.921)	(225.889)	(4.568)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.993	2.348	1.832	–	–	2.176	68.293	563.515	4.953.693	1.215.396

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China Equity

	Thesaurierende Klasse CHF I	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR Z	Ausschüttende Klasse GBP A	Ausschüttende Klasse GBP I2 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse SGD A	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	29.100	69.274	53.783	891	1.265	–	72.240	1.123.752	49.808	8.620.770
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	5	–	–	–	–	113
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(11.000)	(15.241)	(3.666)	–	–	–	(7.777)	(285.858)	(1.250)	(3.067.712)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	18.100	54.033	50.117	891	1.270	–	64.463	837.894	48.558	5.553.171
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	29.100	91.322	59.292	891	16.265	9.629	82.932	1.511.178	80.016	10.238.115
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	5.565	–	–	–	–	–	–	173
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(22.048)	(11.074)	–	(15.000)	(9.629)	(10.692)	(387.426)	(30.208)	(1.617.518)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	29.100	69.274	53.783	891	1.265	–	72.240	1.123.752	49.808	8.620.770

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD U	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	882.670	1.356	1.464.746	16.176
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	984.661	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(304.835)	–	(333.260)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.562.496	1.356	1.131.486	16.176
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	981.572	2.273.337	1.745.160	16.176
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(98.902)	(2.271.981)	(280.414)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	882.670	1.356	1.464.746	16.176

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Climate Innovation[1]

	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD Z*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.000	1.000	1.000	300.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.000	1.000	1.000	300.000

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

CLO Income

	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse GBP I2*	Ausschüttende Klasse GBP I5*	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse SEK I	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	6.454	1.114.755	1.593.672	2.711.194	–	4.854	279.735	6.339	1.278.134	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	1.552.035	482.891	3.123	–	–	–	937	3.511.722	251.228
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.630)	(76.687)	(878.268)	(2.714.317)	–	–	(35.671)	(3.732)	(462.335)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.824	2.590.103	1.198.295	–	–	4.854	244.064	3.544	4.327.521	251.228
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	180.581	1.527.618	3.291.633	2.780	7.139	308.215	–	1.553.808	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	6.454	1.065.824	99.074	18.444	–	–	–	6.339	652.959	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(131.650)	(33.020)	(598.883)	(2.780)	(2.285)	(28.480)	–	(928.633)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	6.454	1.114.755	1.593.672	2.711.194	–	4.854	279.735	6.339	1.278.134	–

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I5	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.310.195	4.382.421	42.619
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.293.641	423.722	9.365
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(387.440)	(1.460.411)	(817)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.216.396	3.345.732	51.167
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.478.474	4.117.440	42.619
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	831.721	264.981	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.310.195	4.382.421	42.619

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Commodities[2]

	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I5*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD M*	Thesaurierende Klasse USD Z*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	806	1.725.093	300.455	41.114	6.131.791	48.584	234.681
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.674.061	2.389.727	16.070	170.210	912.952	–	11.719
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(86.476)	(670.077)	(189.824)	(44.686)	(974.952)	(2.326)	(17.300)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.588.391	3.444.743	126.701	166.638	6.069.791	46.258	229.100
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	806	2.057.623	322.881	553.882	6.833.789	62.411	250.306
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(332.530)	(22.426)	(512.768)	(701.998)	(13.827)	(15.625)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	806	1.725.093	300.455	41.114	6.131.791	48.584	234.681

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse CHF P	Ausschüttende Klasse CHF P	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR I3
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	611.478	2.376.179	175.980	4.852.015	12.011.204	59.251.810	10.344.724	18.775.751	21.723.355	696.618
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	51.225	74.865	16.077	495.060	3.923.047	33.509.401	9.941.754	7.714.386	1.339.335	35.760
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(27.467)	(1.985.477)	(10.953)	(486.251)	(2.452.059)	(20.698.470)	(3.515.018)	(3.078.340)	(16.682.411)	(328.156)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	635.236	465.567	181.104	4.860.824	13.482.192	72.062.741	16.771.460	23.411.797	6.380.279	404.222
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	972.918	4.846.082	270.761	5.082.911	14.953.377	51.923.840	9.516.581	25.053.140	18.068.754	800.660
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	231.156	24.861	531.196	2.164.517	36.312.718	8.439.193	3.323.164	6.804.679	177.517
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(361.440)	(2.701.059)	(119.642)	(762.092)	(5.106.690)	(28.984.748)	(7.611.050)	(9.600.553)	(3.150.078)	(281.559)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	611.478	2.376.179	175.980	4.852.015	12.011.204	59.251.810	10.344.724	18.775.751	21.723.355	696.618

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR P	Ausschüttende Klasse EUR P	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I2	Thesaurierende Klasse GBP P	Ausschüttende Klasse GBP P
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	16.332.716	1.064.639	467.056	3.826.066	503.225	516.297	944.439	44.753	638.477	846.035
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	59.423	254.592	97.607	113.944	1.670.754	48.015	7.783	87	73.518	154.561
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(7.219.454)	(363.707)	(136.377)	(3.091.825)	(127.960)	(366.879)	(799.114)	(42.336)	(565.831)	(260.860)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	9.172.685	955.524	428.286	848.185	2.046.019	197.433	153.108	2.504	146.164	739.736
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	8.067.969	956.414	566.440	15.072.977	913.586	622.213	5.491.683	207.127	736.727	527.896
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	8.264.747	446.153	54.740	1.312.924	37.109	204.270	1.269.412	37.591	449.772	711.946
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(337.928)	(154.124)	(12.559.835)	(447.470)	(310.186)	(5.816.656)	(199.965)	(548.022)	(393.807)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	16.332.716	1.064.639	467.056	3.826.066	503.225	516.297	944.439	44.753	638.477	846.035

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD M
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	87.891	6.691.421	4.384.732	7.910	611.702	4.388.388	166.429	582.240	525.564	826.171
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	19.551	428.125	665.491	–	–	1.071.125	7.892	41.876	–	54.287
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(356)	(1.320.177)	(1.024.003)	–	(286.051)	(1.973.285)	(65.494)	(158.024)	(26.140)	(191.931)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	107.086	5.799.369	4.026.220	7.910	325.651	3.486.228	108.827	466.092	499.424	688.527
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	125.739	9.233.259	5.532.404	7.910	859.901	15.782.837	131.085	6.481.087	124.890	1.056.212
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	394	378.686	540.681	–	–	2.299.939	35.344	18.993	546.581	21.690
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(38.242)	(2.920.524)	(1.688.353)	–	(248.199)	(13.694.388)	–	(5.917.840)	(145.907)	(251.731)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	87.891	6.691.421	4.384.732	7.910	611.702	4.388.388	166.429	582.240	525.564	826.171

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	269.098	1.406.289	33.730
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	24.175	36.223	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(55.336)	(808.013)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	237.937	634.499	33.730
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	300.463	5.415.895	16.723
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	8.128	538.232	17.007
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(39.493)	(4.547.838)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	269.098	1.406.289	33.730

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027[1]

	Thesaurierende Klasse EUR A*	Ausschüttende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse USD A*	Ausschüttende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I*	Ausschüttende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD X*	Ausschüttende Klasse USD X*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr								
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	67.923	29.700	6.693.273	2.841.848	94.000	208.269	3.753.888	200.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	(243.116)	–	–	(300.903)	(115.958)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	67.923	29.700	6.693.273	2.598.732	94.000	208.269	3.452.985	84.042

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD I	Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse CHF I2	Thesaurierende Klasse CHF P	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert)	Ausschüttende Klasse EUR I
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	310.297	2.773.139	4.300.000	20.893.906	2.782.320	1.188.410	3.418.120	11.499.248	1.959.764	27.569.346
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	47.366	3.831.153	–	1.897.886	463.983	204.834	1.810.788	1.950.853	312.490	2.152.511
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(82.980)	(3.812.069)	–	(6.907.986)	(269.424)	(187.540)	(369.886)	(5.641.539)	(496.993)	(4.177.367)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	274.683	2.792.223	4.300.000	15.883.806	2.976.879	1.205.704	4.859.022	7.808.562	1.775.261	25.544.490
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	336.608	3.044.734	–	5.175.988	3.624.178	1.268.188	2.537.540	26.528.625	111.663	30.832.656
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	10.636	279.725	4.300.000	22.773.581	601.730	97.218	2.441.751	3.451.354	2.474.758	2.396.628
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(36.947)	(551.320)	–	(7.055.663)	(1.443.588)	(176.996)	(1.561.171)	(18.480.731)	(626.657)	(5.659.938)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	310.297	2.773.139	4.300.000	20.893.906	2.782.320	1.188.410	3.418.120	11.499.248	1.959.764	27.569.346

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungs-gesichert)*	Ausschüttende Klasse EUR I3*	Thesaurierende Klasse EUR I4	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR P	Thesaurierende Klasse EUR Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr											
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile											
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.800.989	4.735.609	11.460.021	3.314.347	–	10.690.026	6.860.859	69.876	22.186	1.210.699	36.061
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.942.146	278.590	5.492.556	–	–	4.194.833	6.067.456	–	2	70.412	23.444
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(6.519.570)	(78.118)	(9.946.888)	(3.314.347)	–	(10.917.044)	(4.799.159)	(16.250)	(343)	(102.826)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	5.223.565	4.936.081	7.005.689	–	–	3.967.815	8.129.156	53.626	21.845	1.178.285	59.505
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr											
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile											
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	10.113.936	4.323.512	9.873.905	3.857.277	281.619	13.665.964	–	76.470	27.801	4.228.081	36.061
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.344.344	525.000	6.856.961	760.000	–	1.172.856	9.378.359	–	2	557.075	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.657.291)	(112.903)	(5.270.845)	(1.302.930)	(281.619)	(4.148.794)	(2.517.500)	(6.594)	(5.617)	(3.574.457)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.800.989	4.735.609	11.460.021	3.314.347	–	10.690.026	6.860.859	69.876	22.186	1.210.699	36.061

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I2	Thesaurierende Klasse GBP P	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse SEK A	Thesaurierende Klasse SEK I (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse SEK I2
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.714.081	269.731	3.773.875	1.643.379	881.407	170.604	2.000.000	12.436.581	–	1.745.948
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	688.135	39.346	2.737.197	1.447.188	315.611	91.300	–	3.347.211	–	1.593.887
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.074.473)	(167.964)	(1.024.895)	(1.209.170)	(546.685)	(62.907)	–	(9.605.852)	–	(2.565.382)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.327.743	141.113	5.486.177	1.881.397	650.333	198.997	2.000.000	6.177.940	–	774.453
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.029.895	865.850	3.585.859	1.896.188	602.152	234.729	2.000.000	8.669.815	2.990	2.672.239
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	460.640	43.533	1.275.053	110.509	351.785	31.995	–	7.443.000	–	1.377.284
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(776.454)	(639.652)	(1.087.037)	(363.318)	(72.530)	(96.120)	–	(3.676.234)	(2.990)	(2.303.575)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.714.081	269.731	3.773.875	1.643.379	881.407	170.604	2.000.000	12.436.581	–	1.745.948

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I3
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.211.426	21.006.868	9.982.109	5.499	1.198.416	48.424.011	10.480.066	3.229.040	1.755.587	10.702.171
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	927.916	8.540.687	2.088.892	39.610	–	15.910.168	254.203	25.524.047	2.423.190	115.144
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(744.820)	(10.328.267)	(2.584.869)	–	(147.068)	(22.656.741)	(1.907.569)	(5.822.348)	(1.760.452)	(62.418)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.394.522	19.219.288	9.486.132	45.109	1.051.348	41.677.438	8.826.700	22.930.739	2.418.325	10.754.897
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.262.462	30.136.140	12.003.717	2.430	1.421.409	57.055.486	15.142.161	14.157.129	2.892.812	10.470.561
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	188.711	8.143.098	1.664.679	7.392	–	22.235.525	733.266	1.009.450	591.308	594.440
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(239.747)	(17.272.370)	(3.686.287)	(4.323)	(222.993)	(30.867.000)	(5.395.361)	(11.937.539)	(1.728.533)	(362.830)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.211.426	21.006.868	9.982.109	5.499	1.198.416	48.424.011	10.480.066	3.229.040	1.755.587	10.702.171

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr					
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.893.262	486.711	1.966.497	12.069.574	9.753
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	206.826	76.873	4.914.966	–	250
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(353.278)	(26.849)	(794.797)	–	(250)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.746.810	536.735	6.086.666	12.069.574	9.753
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr					
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.202.670	491.168	2.774.160	2.500.000	820.791
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	332.572	32.117	432.042	9.569.574	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(641.980)	(36.574)	(1.239.705)	–	(811.038)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.893.262	486.711	1.966.497	12.069.574	9.753

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency

	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD B	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse AUD C2	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD E	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD T	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.011.815	36.723	19.109	1.035	113.572	5.703	7.223.444	266.766	416.611	1.814.361
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	157.199	13.139	–	925	95.750	6.521	873.320	12.401	251.037	2.675.328
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(689.985)	(15.218)	(19.109)	(1.034)	(64.554)	(3.961)	(1.316.251)	(42.817)	(392.961)	(1.020.709)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	479.029	34.644	–	926	144.768	8.263	6.780.513	236.350	274.687	3.468.980
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.874.215	60.489	72.201	15.252	427.610	7.478	7.062.666	267.908	3.348.101	3.668.913
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	32.920	23.258	–	–	19.711	316	1.939.354	49.791	437.240	16.598
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.895.320)	(47.024)	(53.092)	(14.217)	(333.749)	(2.091)	(1.778.576)	(50.933)	(3.368.730)	(1.871.150)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.011.815	36.723	19.109	1.035	113.572	5.703	7.223.444	266.766	416.611	1.814.361

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungs-gesichert)	Ausschüttende Klasse EUR I3 (nicht währungs-gesichert)*	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungs-gesichert)	Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungs-gesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungs-gesichert)
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	16.617.422	1.203.690	–	2.575.012	–	8.570.577	9.350	5.761.938	4.826.229	5.545.152
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	613.431	88.000	–	–	–	262.605	35.152	3.670.139	3.177.866	299.059
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.370.365)	–	–	–	–	(1.086.932)	(1.395)	(1.752.548)	(2.556.466)	(2.122.014)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	15.860.488	1.291.690	–	2.575.012	–	7.746.250	43.107	7.679.529	5.447.629	3.722.197
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	19.419.261	3.066.056	1.155.703	2.575.012	33.468	9.831.973	8.914	9.362.787	10.591.181	12.369.887
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.030.549	–	22.447	–	622	313.175	436	76.647	1.936.702	1.795.578
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(4.832.388)	(1.862.366)	(1.178.150)	–	(34.090)	(1.574.571)	–	(3.677.496)	(7.701.654)	(8.620.313)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	16.617.422	1.203.690	–	2.575.012	–	8.570.577	9.350	5.761.938	4.826.229	5.545.152

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse SEK A	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD B	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD C2*	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD E
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	102.692	40.442	584.118	1.720.702	2.987.299	69.674	131.749	2.864	827.707	39.193
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	26.432	72.846	224.429	155.635	2.535.938	128.492	–	–	544.831	37.046
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(43.921)	(48.388)	(39.200)	(331.387)	(2.677.045)	(140.224)	(130.847)	(2.864)	(937.401)	(47.188)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	85.203	64.900	769.347	1.544.950	2.846.192	57.942	902	–	435.137	29.051
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	111.944	48.992	1.068.304	2.052.642	7.146.348	270.658	363.914	10.263	1.579.392	83.939
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.096	4.798	11.784	426.493	1.236.935	23.550	38.562	–	140.879	2.985
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(16.348)	(13.348)	(495.970)	(758.433)	(5.395.984)	(224.534)	(270.727)	(7.399)	(892.564)	(47.731)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	102.692	40.442	584.118	1.720.702	2.987.299	69.674	131.749	2.864	827.707	39.193

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I5	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD T	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Y	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	5.289.657	44.694.639	77.414	6.703.311	2	11.229.883	472.178	17.117.475	19.204.022	3.381.337
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	419.314	6.030.817	90.800	2.144.542	1.579	2.428.036	105.832	–	314.212	627.026
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.176.000)	(30.311.291)	(11.200)	(1.233.348)	–	(2.168.217)	(127.810)	(2.091.973)	(2.266.092)	(2.746.974)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.532.971	20.414.165	157.014	7.614.505	1.581	11.489.702	450.200	15.025.502	17.252.142	1.261.389
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.668.272	49.154.691	1.949.580	9.446.506	2	10.232.675	364.727	16.751.294	20.191.331	7.756.959
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	192.560	3.700.133	73.206	1.151.195	–	4.245.889	223.077	803.818	2.769.806	777.350
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.571.175)	(8.160.185)	(1.945.372)	(3.894.390)	–	(3.248.681)	(115.626)	(437.637)	(3.757.115)	(5.152.972)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	5.289.657	44.694.639	77.414	6.703.311	2	11.229.883	472.178	17.117.475	19.204.022	3.381.337

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR B	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR C2	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR E	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR T
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	61.413	79.825	918	565.614	7.324	13.901.287	350.741
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	82.750	2.171	1.596	286.872	39.298	2.870.617	54.777
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(49.494)	(80.131)	(918)	(462.017)	(44.807)	(2.675.598)	(41.044)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	94.669	1.865	1.596	390.469	1.815	14.096.306	364.474
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	167.621	271.158	19.288	1.819.795	31.946	12.509.758	270.673
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.576	1.324	–	1.066.419	3.607	4.980.625	146.137
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(109.784)	(192.657)	(18.370)	(2.320.600)	(28.229)	(3.589.096)	(66.069)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	61.413	79.825	918	565.614	7.324	13.901.287	350.741

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

	Ausschüttende Klasse AUD I3	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.104.926	1.087.375	20.867.944	3.568.511	1.904.679	1.433.425	3.000	59.066	1.963.354	53.295
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	39.376	154.942	2.618.624	342.925	34.771	168.899	4.738.000	121.106	104.206	6.388
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(129.541)	(204.956)	(1.324.356)	(732.826)	(692.964)	(368.248)	–	–	(303.883)	(7.461)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.014.761	1.037.361	22.162.212	3.178.610	1.246.486	1.234.076	4.741.000	180.172	1.763.677	52.222
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	838.742	735.712	25.576.646	4.799.433	3.429.534	2.352.885	3.000	50.811	2.300.297	64.193
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	266.184	622.266	4.500.693	757.995	205.500	86.385	–	8.255	143.294	4.701
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(270.603)	(9.209.395)	(1.988.917)	(1.730.355)	(1.005.845)	–	–	(480.237)	(15.599)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.104.926	1.087.375	20.867.944	3.568.511	1.904.679	1.433.425	3.000	59.066	1.963.354	53.295

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP P	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse NOK U
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	39.883	9.487	32.887	539	1.454.417	66.844	723.194	97.670	16.888	2.285
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	141.769	4.348	19.482	–	183.622	29.269	73.965	2.017	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(7.233)	(750)	(13.704)	(2)	(427.890)	(28.665)	(490.449)	(11.028)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	174.419	13.085	38.665	537	1.210.149	67.448	306.710	88.659	16.888	2.285
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	68.909	9.487	47.813	7.969.618	2.129.774	67.660	6.702.498	120.606	16.888	2.285
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	5.848	–	6.070	9.497	485.624	5.957	1.598.832	32.606	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(34.874)	–	(20.996)	(7.978.576)	(1.160.981)	(6.773)	(7.578.136)	(55.542)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	39.883	9.487	32.887	539	1.454.417	66.844	723.194	97.670	16.888	2.285

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse SEK A	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2*	Ausschüttende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I3*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	265.050	327.916	54.657	981.528	128.728	2.807.500	54.262	–	5.530.120	4.576.696
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	152.562	7.429	2.385	13.304	–	449.658	–	–	586.697	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(180.647)	(5.350)	(6.668)	(419.509)	(37.676)	(1.737.939)	(8.236)	–	(701.271)	(4.576.696)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	236.965	329.995	50.374	575.323	91.052	1.519.219	46.026	–	5.415.546	–
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	255.617	331.074	53.122	1.077.163	138.851	8.302.920	183.411	857	6.511.508	4.576.696
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	240.910	583	1.535	121.202	–	582.689	–	–	334.979	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(231.477)	(3.741)	–	(216.837)	(10.123)	(6.078.109)	(129.149)	(857)	(1.316.367)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	265.050	327.916	54.657	981.528	128.728	2.807.500	54.262	–	5.530.120	4.576.696

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD Me	Thesaurierend Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	88.987	81.894	9.459
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.262.906	–	23.358	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(9.187)	(10.743)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.262.906	79.800	94.509	9.459
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	117.705	73.585	10.645
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	16.799	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(28.718)	(8.490)	(1.186)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	88.987	81.894	9.459

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

	Thesaurierende Klasse AUD I2	Thesaurierende Klasse NOK I	Thesaurierende Klasse NOK I3*	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr						
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.533.722	2.885.428	–	3.680	470.000	492.314
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	1.792.862	3.694.799	–	–	212.458
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(4.649.563)	(14.316)	–	–	(94.684)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.533.722	28.727	3.680.483	3.680	470.000	610.088
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr						
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.533.722	1.297.729	–	253.797	470.000	348.996
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	2.051.255	–	–	–	250.358
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(463.556)	–	(250.117)	–	(107.040)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.533.722	2.885.428	–	3.680	470.000	492.314

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity

	Thesaurierende Klasse AUD B	Thesaurierende Klasse AUD C2	Thesaurierende Klasse AUD E	Thesaurierende Klasse AUD T	Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungs-gesichert)	Ausschüttende Klasse CAD I2	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z	Thesaurierende Klasse GBP I
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	42.721	1.253	13.736	179.662	8.285	1.492.500	158.403	43.504	22.279	39.061
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.713	1.575	–	17.318	–	–	18.826	1.105	–	970
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(18.174)	(1.253)	(9.219)	(21.706)	–	–	(98.758)	(4.485)	–	(1.047)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	29.260	1.575	4.517	175.274	8.285	1.492.500	78.471	40.124	22.279	38.984
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	77.425	6.917	11.885	187.792	10.285	1.492.500	381.451	46.687	22.279	38.853
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	17.986	409	3.069	34.641	–	–	61.061	2.364	–	11.671
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(52.690)	(6.073)	(1.218)	(42.771)	(2.000)	–	(284.109)	(5.547)	–	(11.463)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	42.721	1.253	13.736	179.662	8.285	1.492.500	158.403	43.504	22.279	39.061

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse JPY I*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD C2	Thesaurierende Klasse USD E	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD T	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	6.841	–	510.968	142.250	12.018	26.692	14.554.442	37.562	354.357	1.020.891
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	49.332	147.850	8.954	132.366	2.460.892	56.218	3.658.770	1.313.056
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	(40.321)	(208.672)	(20.005)	(145.899)	(13.374.360)	(54.541)	(3.660.850)	(330.781)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	6.841	–	519.979	81.428	967	13.159	3.640.974	39.239	352.277	2.003.166
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	17.841	1.174.407	476.703	328.832	33.145	19.471	15.399.570	6.185.010	356.194	1.709.914
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	117.946	103.942	4.188	28.447	2.982.466	25.478	2.728.820	410.041
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(11.000)	(1.174.407)	(83.681)	(290.524)	(25.315)	(21.226)	(3.827.594)	(6.172.926)	(2.730.657)	(1.099.064)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	6.841	–	510.968	142.250	12.018	26.692	14.554.442	37.562	354.357	1.020.891

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR B	Thesaurierende Klasse ZAR C2	Thesaurierende Klasse ZAR E	Thesaurierende Klasse ZAR T
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	51.412	9.331	32.536	186.675
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	36.066	179	11.109	43.286
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(49.709)	(9.148)	(14.649)	(59.970)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	37.769	362	28.996	169.991
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	90.926	20.376	44.151	164.928
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	67.137	275	–	72.365
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(106.651)	(11.320)	(11.615)	(50.618)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	51.412	9.331	32.536	186.675

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Select Equity**

	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse USD I*	Ausschüttende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I5*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr					
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	230.967	1.141.036	9.264.115	–	8.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	89.745	–	6.235	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(320.712)	(1.141.036)	(9.270.350)	–	(8.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr					
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	316.974	1.143.998	9.194.294	2.882	15.950
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	182.949	–	83.094	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(268.956)	(2.962)	(13.273)	(2.882)	(7.950)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	230.967	1.141.036	9.264.115	–	8.000

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.
** Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Euro Bond

	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr		
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.902	978.926
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	51.761	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	59.663	978.926
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr		
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.000	978.926
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.902	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.902	978.926

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return

	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	215.032	930	1.768.586	2.708.212
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.788	–	60.992	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(129.142)	–	(1.345.703)	(185.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	89.678	930	483.875	2.523.212
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	387.980	1.377.486	2.016.235	1.314.758
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	38.756	930	639.539	1.393.454
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(211.704)	(1.377.486)	(887.188)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	215.032	930	1.768.586	2.708.212

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

	Thesaurierende Klasse CHF I*	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2*	Thesaurierende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR X	Thesaurierende Klasse EUR Y*	Ausschüttende Klasse EUR Y	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	70.978	–	–	46.402	484.244	–	–	–	39.764
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	169.131	3.345.324	19.772	599.602	39.741	3.578.268	25.017.638	273.800	–	10.696
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.011)	(46.667)	–	–	(23.437)	(94.523)	(105.006)	–	–	(11.536)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	167.120	3.369.635	19.772	599.602	62.706	3.967.989	24.912.632	273.800	–	38.924
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	59.014	–	–	37.016	479.831	–	–	3.481	160.081
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	12.718	–	–	10.250	4.413	–	–	6.750	5.332
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(754)	–	–	(864)	–	–	–	(10.231)	(125.649)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	70.978	–	–	46.402	484.244	–	–	–	39.764

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	16.131	222.524	2.161.439
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	38.512	626.959
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.276)	(218.884)	(1.300.133)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	13.855	42.152	1.488.265
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.043.739	631.554	861.306
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	299	–	1.300.133
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.027.907)	(409.030)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	16.131	222.524	2.161.439

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity

	Ausschüttende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z	Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungs-gesichert)
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.627	3.190	1.027	16.220.988	212.473	2.396	3.569.643	1.000	1.971.793	1.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.090	–	–	1.308.425	24.661	1.825	1.647.905	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.090)	–	–	(5.271.427)	(17.898)	(384)	(450)	–	(1.970.793)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.627	3.190	1.027	12.257.986	219.236	3.837	5.217.098	1.000	1.000	1.000
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	2.992	3.544.179	4.652.561	200.000	2.396	26.561	1.000	1.971.793	1.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.627	1.315	1.027	14.308.101	12.633	–	3.543.082	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(1.117)	(3.544.179)	(2.739.674)	(160)	–	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.627	3.190	1.027	16.220.988	212.473	2.396	3.569.643	1.000	1.971.793	1.000

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Event Driven[2]

	Thesaurierende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse GBP I5*	Ausschüttende Klasse GBP I5*	Thesaurierende Klasse GBP P*	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I5*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr						
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	2.369.000	2.584	2.584	1.001.000	242.352
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	39.011	5.976.587	1.354.344	–	–	1.198.538
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(38.088)	(1.123.229)	(207.394)	–	(1.000.000)	(136.293)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	923	7.222.358	1.149.534	2.584	1.000	1.304.597
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr						
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	2.369.000	2.584	2.584	1.001.000	242.352
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	2.369.000	2.584	2.584	1.001.000	242.352

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Bond

	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungs-gesicherte Klasse*	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungs-gesicherte Klasse*	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD Z	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.937	–	48.437	3.000	148.271	28.428	3.000	13.134.827	4.481
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	2.766	–	–	468.227	56.948	–	688.840	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	(10.696)	–	(303.317)	(41.294)	–	(4.118.948)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.937	2.766	37.741	3.000	313.181	44.082	3.000	9.704.719	4.481
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.937	–	62.811	–	148.271	71.273	3.000	14.839.075	4.481
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	3.000	–	–	–	1.420.929	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	(14.374)	–	–	(42.845)	–	(3.125.177)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.937	–	48.437	3.000	148.271	28.428	3.000	13.134.827	4.481

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024

	Thesaurierende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse HKD A	Ausschüttende Klasse SGD A	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	122.227	25.000	100.000	214.842	750.000	262.720	2.950.200	4.579.424	253.567	224.117
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	3.995	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	(9.843)	–	(25.000)	(359.672)	(556.942)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	122.227	25.000	100.000	204.999	750.000	237.720	2.590.528	4.026.477	253.567	224.117
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	122.227	25.000	100.000	214.842	750.000	272.720	3.387.413	5.097.571	379.967	243.821
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	2.181	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	(10.000)	(437.213)	(520.328)	(126.400)	(19.704)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	122.227	25.000	100.000	214.842	750.000	262.720	2.950.200	4.579.424	253.567	224.117

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD X	Ausschüttende Klasse USD X
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr		
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.104.508	5.781.902
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.104.508	5.781.902
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr		
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.104.508	10.781.902
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(5.000.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.104.508	5.781.902

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

	Thesaurierende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse SGD A*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	392.901	–	–	2.717.651	302.253	747.642	1.482.972	1.012.699
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	757.848	152.789	786	2.010	1.009.129	–	2.092.148	488.858	1.098.322
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.817)	(57.962)	–	–	(835.553)	(44.835)	(640.872)	(450.992)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	756.031	487.728	786	2.010	2.891.227	257.418	2.198.918	1.520.838	2.111.021
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	183.655	–	–	2.297.293	304.508	1.309.925	1.605.824	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	242.316	–	–	999.209	–	387.698	287.778	1.347.320
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(33.070)	–	–	(578.851)	(2.255)	(949.981)	(410.630)	(334.621)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	392.901	–	–	2.717.651	302.253	747.642	1.482.972	1.012.699

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income

	Thesaurierende Klasse CAD I5	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse GBP I5	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.500.000	376.242	42.202	18.706.078	937.398	11.735.927	34.986	580.784	485.090
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	399.091	8.248	1.524.684	166.296	2.115.137	–	85.523	10.704
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(103.413)	(369.708)	(6.106)	(7.313.951)	(188.671)	(540.234)	–	(62.015)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.396.587	405.625	44.344	12.916.811	915.023	13.310.830	34.986	604.292	495.794
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.500.000	299.356	38.595	33.076.878	982.153	11.653.437	38.979	571.721	930.894
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	107.508	9.471	6.974.366	245.888	192.595	–	128.463	14.178
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(30.622)	(5.864)	(21.345.166)	(290.643)	(110.105)	(3.993)	(119.400)	(459.982)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.500.000	376.242	42.202	18.706.078	937.398	11.735.927	34.986	580.784	485.090

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global SDG Engagement

	Ausschüttende Klasse AUD I*	Thesaurierende Klasse CHF I4*	Ausschüttende Klasse CHF I4*	Thesaurierende Klasse CHF X*	Thesaurierende Klasse EUR I4*	Ausschüttende Klasse EUR I4*	Thesaurierende Klasse EUR X*	Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)	Thesaurierende Klasse GBP I4*	Thesaurierende Klasse GBP X*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	4.223	3.658.671	226.381	2.931	3.611.348	96.247	2.846	2.044.067	833.380	2.398
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	4.875.169	343.161	–	4.502.144	55.133	–	255.131	1.182.689	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(1.133.029)	(57.140)	–	(1.858.016)	(35.704)	–	(233.436)	(300.995)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.223	7.400.811	512.402	2.931	6.255.476	115.676	2.846	2.065.762	1.715.074	2.398
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	1.967.593	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.223	5.993.488	339.523	2.931	6.256.908	141.559	2.846	239.186	1.449.844	2.398
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(2.334.817)	(113.142)	–	(2.645.560)	(45.312)	–	(162.712)	(616.464)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.223	3.658.671	226.381	2.931	3.611.348	96.247	2.846	2.044.067	833.380	2.398

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I4*	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr						
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	53.218	6.992	22.306.996	157.097	2.013	657.453
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	414.155	11.989.848	3.718	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.000)	(6.175)	(3.981.033)	(2.863)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	50.218	414.972	30.315.811	157.952	2.013	657.453
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr						
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	68.756	9.572	–	230.509	1.000	656.664
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	995	816	27.180.169	83.387	1.013	789
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(16.533)	(3.396)	(4.873.173)	(156.799)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	53.218	6.992	22.306.996	157.097	2.013	657.453

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global High Yield Sustainable Action**

	Thesaurierende Klasse USD I*	Ausschüttende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD Y*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.000	1.458.132	1.000	300.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.000)	(1.458.132)	(1.000)	(300.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.000	1.458.132	1.000	300.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.000	1.458.132	1.000	300.000

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.
** Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit

	Thesaurierende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	145.058	5.002.702	4.998.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.730	51.487	–	535
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(4.340)	(668.585)	(200.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.730	192.205	4.334.117	4.798.535
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	1.000	5.001.417	4.998.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	144.058	1.285	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	145.058	5.002.702	4.998.000

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse GBP P	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD M*	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr								
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	967.405	2.295	47.120	379.169	942.090	2.391.648	–	2.868.980
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.530	–	853	23.993	309.278	22.772	–	84.231
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(967.405)	–	(46.046)	(10.193)	–	(291.069)	–	(595.978)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.530	2.295	1.927	392.969	1.251.368	2.123.351	–	2.357.233
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr								
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	454.585	2.295	65.944	1.059.158	942.090	2.269.235	83.656	3.312.736
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	512.820	–	190	379.017	–	395.349	1.935	803.213
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	(19.014)	(1.059.006)	–	(272.936)	(85.591)	(1.246.969)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	967.405	2.295	47.120	379.169	942.090	2.391.648	–	2.868.980

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities

	Ausschüttende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD CI	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I5	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.173.704	103.501	9.210	7.307	437.183	14.639	1.323.134	320.057	74.771	277.113
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	146.514	7.341	9.234	–	28.812	–	97.887	–	2.817	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.320.218)	(24.530)	(300)	–	(136.094)	–	(506.106)	(316.742)	(2.022)	(103.001)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	86.312	18.144	7.307	329.901	14.639	914.915	3.315	75.566	174.112
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	809.283	100.679	8.510	7.007	492.609	17.770	1.204.954	320.057	160.948	357.656
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	421.681	14.038	700	300	129.425	4.042	880.811	–	18.490	178.571
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(57.260)	(11.216)	–	–	(184.851)	(7.173)	(762.631)	–	(104.667)	(259.114)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.173.704	103.501	9.210	7.307	437.183	14.639	1.323.134	320.057	74.771	277.113

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity

	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungs-gesichert)	Ausschüttende Klasse EUR I5 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr											
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile											
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.828.939	–	6.081	124.615	53.508	404.831	71.933	1.202.620	1.131	42.328	3.468.551
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	859.111	–	852	664	53.464	99.618	18.698	310.136	–	–	286.772
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.510.479)	–	–	(2.455)	(21.886)	(123.076)	(37.758)	(490.317)	–	(2.110)	(89.560)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.177.571	–	6.933	122.824	85.086	381.373	52.873	1.022.439	1.131	40.218	3.665.763
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr											
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile											
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	8.434.035	–	5.048	126.953	722	723	3.877	1.951.221	2.830.918	1.378.094	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	5.670.939	128.325	1.122	2.689	55.858	487.376	70.294	667.682	1.131	36.447	4.323.346
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(6.276.035)	(128.325)	(89)	(5.027)	(3.072)	(83.268)	(2.238)	(1.416.283)	(2.830.918)	(1.372.213)	(854.795)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.828.939	–	6.081	124.615	53.508	404.831	71.933	1.202.620	1.131	42.328	3.468.551

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value

	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I3*	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	34.497	927	–	132.262	178.944	2.442.209	1.062.770
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.179	–	823	31.243	441.693	580.185	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.658)	–	–	(87.879)	(83.211)	(219.433)	(499.410)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	33.018	927	823	75.626	537.426	2.802.961	563.360
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	37.248	–	–	62.071	15.459	–	903.522
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.074	927	–	127.259	1.883.989	2.515.374	801.702
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.825)	–	–	(57.068)	(1.720.504)	(73.165)	(642.454)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	34.497	927	–	132.262	178.944	2.442.209	1.062.770

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD A	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD B	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD E	Ausschüttende Klasse AUD I	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.927.970	242.834	3.006.534	104.092	85.032	192.233	40.111	2.691.160	13.609.831	143.194
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	25.904	–	418.352	36.589	48	294.551	45.985	49.415	1.019.120	1.336
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(512.929)	(52.238)	(1.319.744)	(32.354)	(84.426)	(188.343)	(51.710)	(938.459)	(1.870.973)	(8.585)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.440.945	190.596	2.105.142	108.327	654	298.441	34.386	1.802.116	12.757.978	135.945
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.252.446	352.388	4.522.124	152.294	169.903	452.484	186.086	6.153.126	14.551.556	179.079
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	9.555	–	478.263	63.876	607	84.076	21.961	254.326	1.368.374	1.166
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(334.031)	(109.554)	(1.993.853)	(112.078)	(85.478)	(344.327)	(167.936)	(3.716.292)	(2.310.099)	(37.051)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.927.970	242.834	3.006.534	104.092	85.032	192.233	40.111	2.691.160	13.609.831	143.194

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse AUD T	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse CHF A	Thesaurierende Klasse CHF I	Thesaurierende Klasse CHF I2	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR A
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	169.905	982.013	319.845	432.280	176.009	191.923	2.682	1.065.293	1.112.989	418.681
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	20.843	14.335	2.455	17.291	73.974	754	–	109.148	518.681	143
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(71.406)	(109.486)	(83.935)	(432.664)	(32.408)	(34.963)	–	(220.122)	(1.352.037)	(66.501)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	119.342	886.862	238.365	16.907	217.575	157.714	2.682	954.319	279.633	352.323
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	97.037	1.360.593	395.532	47.592	213.840	208.694	181.377	1.449.596	1.361.660	457.422
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	90.853	195.811	40.740	401.833	28.911	3.945	–	150.440	504.330	3.569
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(17.985)	(574.391)	(116.427)	(17.145)	(66.742)	(20.716)	(178.695)	(534.743)	(753.001)	(42.310)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	169.905	982.013	319.845	432.280	176.009	191.923	2.682	1.065.293	1.112.989	418.681

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse GBP A	Ausschüttende Klasse GBP A
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.304.687	751.660	1.902.298	5.703.153	–	3.914	15.212	421.494	125.815	142.935
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	235.494	–	2.956.995	3.671.796	–	–	–	2.163	–	46
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(503.083)	(128.592)	(760.685)	(1.042.198)	–	(854)	–	–	(26.427)	(22.372)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.037.098	623.068	4.098.608	8.332.751	–	3.060	15.212	423.657	99.388	120.609
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.251.360	1.501.255	1.411.870	141.081	16.640.327	2.946	15.212	785.392	129.318	178.638
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	512.972	5.830	868.636	5.912.755	–	1.801	–	1.688	–	39
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(459.645)	(755.425)	(378.208)	(350.683)	(16.640.327)	(833)	–	(365.586)	(3.503)	(35.742)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.304.687	751.660	1.902.298	5.703.153	–	3.914	15.212	421.494	125.815	142.935

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I2	Thesaurierende Klasse GBP Z	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse SEK A	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse SGD A	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	362.285	881.445	46.512	16.921.590	12.701	5.896.017	626.951	1.638.642	108.171	13.466.807
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.960	9.982	65.479	10.368.432	–	3.089	5.557.328	15.494	204.439	745.002
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(32.359)	(494.658)	(2.720)	(5.028.981)	(3.433)	(398.220)	(783.430)	(278.771)	(143.821)	(3.411.878)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	334.886	396.769	109.271	22.261.041	9.268	5.500.886	5.400.849	1.375.365	168.789	10.799.931
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	362.702	1.655.037	52.756	3.185.857	6.639	6.325.073	695.642	1.953.557	127.467	19.014.699
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	236	50.288	18.513	15.798.271	7.062	82.205	135.137	47.155	–	1.046.046
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(653)	(823.880)	(24.757)	(2.062.538)	(1.000)	(511.261)	(203.828)	(362.070)	(19.296)	(6.593.938)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	362.285	881.445	46.512	16.921.590	12.701	5.896.017	626.951	1.638.642	108.171	13.466.807

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD C	Thesaurierende Klasse USD C1	Ausschüttende Klasse USD C1	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD C2
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	427.606	8.395.075	2.530.429	20.645.450	1.198.731	74.079	263.716	73.867	669.843	215.498
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	182	874.514	68.922	4.476.633	475.758	–	–	653	42.940	276
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(75.261)	(1.984.406)	(361.487)	(6.850.921)	(897.270)	(4.805)	(48.336)	(6.064)	(710.478)	(215.238)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	352.527	7.285.183	2.237.864	18.271.162	777.219	69.274	215.380	68.456	2.305	536
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	282.513	10.802.958	3.620.054	25.932.704	1.606.107	84.877	319.543	89.428	1.226.172	278.674
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	179.024	1.619.297	197.596	4.767.744	882.417	–	–	303	122.568	261
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(33.931)	(4.027.180)	(1.287.221)	(10.054.998)	(1.289.793)	(10.798)	(55.827)	(15.864)	(678.897)	(63.437)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	427.606	8.395.075	2.530.429	20.645.450	1.198.731	74.079	263.716	73.867	669.843	215.498

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD E	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr											
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile											
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.155.711	274.864	7.910.242	16.987.264	2.090.887	6.620.346	19.600.897	19.756.247	13.975.144	45.645	21.113
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.667.224	94.300	548.162	1.793.190	293.308	18.405	3.029.018	11.662.081	923.066	7.807	22.343
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.929.137)	(224.344)	(3.104.804)	(7.831.415)	(740.320)	(53.149)	(7.748.020)	(4.795.066)	–	(18.924)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.893.798	144.820	5.353.600	10.949.039	1.643.875	6.585.602	14.881.895	26.623.262	14.898.210	34.528	43.456
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr											
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile											
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.836.482	315.621	11.152.610	17.515.806	4.464.055	7.343.830	27.499.697	10.777.295	18.079.681	49.242	41.770
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.072.069	218.024	4.726.773	4.362.177	211.675	301.822	2.475.433	12.865.165	–	8.734	133
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.752.840)	(258.781)	(7.969.141)	(4.890.719)	(2.584.843)	(1.025.306)	(10.374.233)	(3.886.213)	(4.104.537)	(12.331)	(20.790)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.155.711	274.864	7.910.242	16.987.264	2.090.887	6.620.346	19.600.897	19.756.247	13.975.144	45.645	21.113

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD P	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)	Thesaurierende Klasse USD T	Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD U	Thesaurierende Klasse USD Z	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	412.350	23.357.518	306.646	631.356	109.686	860.009	5.126.090	6.845.279	134.051	1.349.132
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	66.906	3.193.377	8.779	521.618	–	–	–	2.370.687	10.153	793.513
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(324.519)	(4.559.430)	(25.000)	(325.788)	(1.812)	(352.969)	(1.971.379)	(3.584.026)	(135.946)	(678.066)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	154.737	21.991.465	290.425	827.186	107.874	507.040	3.154.711	5.631.940	8.258	1.464.579
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	664.802	25.143.726	335.777	717.447	109.686	1.023.568	5.546.591	10.350.000	305.726	2.340.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	118.320	4.115.134	9.152	348.411	–	–	1.050.065	2.613.298	17.028	1.184.623
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(370.772)	(5.901.342)	(38.283)	(434.502)	–	(163.559)	(1.470.566)	(6.118.019)	(188.703)	(2.175.491)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	412.350	23.357.518	306.646	631.356	109.686	860.009	5.126.090	6.845.279	134.051	1.349.132

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR E	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR T
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	66.616	28.203.849	112.608
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.164	2.246.458	41.659
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(39.160)	(4.594.714)	(35.799)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	31.620	25.855.593	118.468
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	114.268	30.713.417	157.249
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	61.094	3.450.302	67.013
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(108.746)	(5.959.870)	(111.654)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	66.616	28.203.849	112.608

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G

	Thesaurierende Klasse CHF I4	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I4	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse EUR X	Thesaurierende Klasse SGD A	Thesaurierende Klasse SGD I4	Thesaurierende Klasse SGD X	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	73.557	44.689	126.139	3.853	494.894	2.031	52.763	26.368	19.159	476.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	5.000	–	700	–	1.000	–	9.486	346	535.520	282.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(14.001)	(42.150)	(37.895)	–	–	–	(2.576)	(7.983)	(23.923)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	64.556	2.539	88.944	3.853	495.894	2.031	59.673	18.731	530.756	758.000
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	95.687	12.539	94.116	2.584	494.714	2.031	52.295	26.311	25.197	476.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	14.814	42.150	41.213	1.269	500	–	1.800	2.649	13.112	405.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(36.944)	(10.000)	(9.190)	–	(320)	–	(1.332)	(2.592)	(19.150)	(405.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	73.557	44.689	126.139	3.853	494.894	2.031	52.763	26.368	19.159	476.000

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I4	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD X
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	578.306	1.000	268.235
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.185	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(129.215)	–	(81.678)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	451.276	1.000	186.557
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	758.228	1.000	285.914
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	120.679	–	68.759
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(300.601)	–	(86.438)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	578.306	1.000	268.235

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement

	Ausschüttende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse GBP I5	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse JPY I	Ausschüttende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse JPY I5	Thesaurierende Klasse JPY Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr								
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	6.356.690	39.504	–	2.242	347.161	507.443	673.747	4.840.035
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.662	7.695	1.104.106	1.469.580	34.275	3.180	231.160	786.147
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(6.356.690)	(13.789)	(4.031)	(151.965)	(293.000)	(497.000)	(151.726)	(2.687.766)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.662	33.410	1.100.075	1.319.857	88.436	13.623	753.181	2.938.416
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr								
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	29.970	–	2.242	327.759	3.488.199	503.328	133.863
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	6.558.565	9.534	–	–	25.611	3.186	316.224	4.706.172
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(201.875)	–	–	–	(6.209)	(2.983.942)	(145.805)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	6.356.690	39.504	–	2.242	347.161	507.443	673.747	4.840.035

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX

	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR M*	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse SEK I	Ausschüttende Klasse SEK I	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr								
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	115.547	–	16.762	2.813.386	746	1.081	–	710.542
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	65.287	–	–	914.490	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(45.737)	–	(14.757)	(3.557.520)	(373)	–	–	(702.583)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	135.097	–	2.005	170.356	373	1.081	–	7.959
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr								
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	553.740	2.749	16.762	2.350.496	217.428	1.081	1.294.647	473.699
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	41.991	–	–	1.998.140	13.272	–	–	256.410
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(480.184)	(2.749)	–	(1.535.250)	(229.954)	–	(1.294.647)	(19.567)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	115.547	–	16.762	2.813.386	746	1.081	–	710.542

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income**

	Thesaurierende Klasse EUR I*	Ausschüttende Klasse GBP P*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD C1*	Thesaurierende Klasse USD I*	Ausschüttende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I2*	Thesaurierende Klasse USD M*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr								
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	2.332	652.893	235.557	59.117	12.352	–	147.152
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	1.272	–	–	–	–	1.034
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(2.332)	(654.165)	(235.557)	(59.117)	(12.352)	–	(148.186)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	–
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr								
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile								
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	57.768	2.332	652.502	292.728	108.506	21.895	678.552	210.688
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	29.413	–	59.774	–	247	4.310	27.208	9.186
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(87.181)	–	(59.383)	(57.171)	(49.636)	(13.853)	(705.760)	(72.722)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	2.332	652.893	235.557	59.117	12.352	–	147.152

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.
** Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD X
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	11.363	32.834	2.748.201	1.917.802	2.054.173	137.589	370.324	421.606	494.738	1.910.978
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.324	–	475.757	257.194	323.919	–	384.544	2.198	34.103	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(4.627)	(28.874)	(887.743)	(396.276)	(422.830)	(50.175)	(231.472)	(46.735)	(122.351)	(632.611)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	11.060	3.960	2.336.215	1.778.720	1.955.262	87.414	523.396	377.069	406.490	1.278.367
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	13.186	409.524	2.575.102	1.815.622	1.901.560	219.776	930.498	531.011	588.779	2.209.933
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	900	28.874	1.077.534	331.074	574.460	–	111.239	28.095	97.045	211.124
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.723)	(405.564)	(904.435)	(228.894)	(421.847)	(82.187)	(671.413)	(137.500)	(191.086)	(510.079)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	11.363	32.834	2.748.201	1.917.802	2.054.173	137.589	370.324	421.606	494.738	1.910.978

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Next Generation Space Economy[2]

	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse USD I*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	443.187	113.032	300.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	476.691	290.893	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(56.874)	(13.136)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	863.004	390.789	300.000
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	446.026	113.032	300.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.839)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	443.187	113.032	300.000

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency

	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD I4*	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD X
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	35.120	119.210	19.456	30.051	1.171.040	1.000	1.000	55.388	1.000	2.193
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	321	2.725	–	–	–	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.112)	(18.879)	(3.282)	(1.000)	(1.162.791)	–	–	(21.996)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	33.329	103.056	16.174	29.051	8.249	1.000	1.000	33.392	1.000	2.193
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	35.619	171.476	40.715	41.226	955.959	–	–	67.231	–	1.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	249	776	–	–	1.162.791	1.000	1.000	7.891	1.000	1.193
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(748)	(53.042)	(21.259)	(11.175)	(947.710)	–	–	(19.734)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	35.120	119.210	19.456	30.051	1.171.040	1.000	1.000	55.388	1.000	2.193

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	848.201
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.891.550
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	5.739.751
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	848.201
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	848.201

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse CHF A	Ausschüttende Klasse CHF A	Thesaurierende Klasse CHF I	Ausschüttende Klasse CHF I	Thesaurierende Klasse CHF I2	Ausschüttende Klasse CHF I2	Thesaurierende Klasse CHF I5	Thesaurierende Klasse CHF P
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	329.980	532.977	485.575	121.294	1.310.726	168.480	1.996.523	1.655.388	151.200	2.996.603
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.867	17.900	19.905	–	258.897	89.090	51.607	–	–	950.193
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(132.149)	(500.000)	(165.612)	(38.014)	(910.282)	(151.270)	(1.056.150)	(1.647.282)	(1.600)	(917.884)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	201.698	50.877	339.868	83.280	659.341	106.300	991.980	8.106	149.600	3.028.912
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	328.543	532.977	657.644	118.730	1.506.083	111.470	329.049	1.685.488	406.638	4.062.953
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.439	–	22.399	13.530	207.031	96.000	1.970.828	2.700	–	1.997.643
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2)	–	(194.468)	(10.966)	(402.388)	(38.990)	(303.354)	(32.800)	(255.438)	(3.063.993)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	329.980	532.977	485.575	121.294	1.310.726	168.480	1.996.523	1.655.388	151.200	2.996.603

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR P
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	12.313.118	2.355.226	71.354.629	23.218.416	21.343.869	7.801.041	599.699	289.438	165.016	11.340.764
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.286.977	244.106	38.828.846	876.961	5.674.820	164	147.062	44.958	118.153	799.837
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.162.227)	(466.245)	(45.303.514)	(2.624.261)	(10.000.267)	(1.071.920)	(180.990)	(82.299)	(15.638)	(7.023.786)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	10.437.868	2.133.087	64.879.961	21.471.116	17.018.422	6.729.285	565.771	252.097	267.531	5.116.815
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	15.750.484	2.640.162	104.437.045	20.753.466	10.539.102	1.614.888	585.631	318.221	181.972	13.153.015
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.476.933	399.868	29.397.259	9.213.995	19.141.989	6.360.047	593.013	50.716	7.429	2.733.710
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(4.914.299)	(684.804)	(62.479.675)	(6.749.045)	(8.337.222)	(173.894)	(578.945)	(79.499)	(24.385)	(4.545.961)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	12.313.118	2.355.226	71.354.629	23.218.416	21.343.869	7.801.041	599.699	289.438	165.016	11.340.764

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR U	Ausschüttende Klasse EUR X	Thesaurierende Klasse GBP A	Thesaurierende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I5	Thesaurierende Klasse GBP P	Ausschüttende Klasse GBP P*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	409.924	5.600.000	178.390	456.013	451.110	195.144	61.906.491	17.028.791	171.325	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	259.021	–	–	32.236	107.971	1.114	3.844.487	4.959.455	131.835	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(388.716)	–	(82.664)	(273.627)	(377.002)	(153.755)	(64.356.712)	(3.817.689)	(132.455)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	280.229	5.600.000	95.726	214.622	182.079	42.503	1.394.266	18.170.557	170.705	–
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	548.931	5.600.000	182.824	404.719	558.512	466.043	58.937.663	13.010.262	59.955	28.500
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	8.047	–	71.695	108.375	91.511	96.235	9.805.715	5.859.201	153.152	15.480
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(147.054)	–	(76.129)	(57.081)	(198.913)	(367.134)	(6.836.887)	(1.840.672)	(41.782)	(43.980)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	409.924	5.600.000	178.390	456.013	451.110	195.144	61.906.491	17.028.791	171.325	–

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse JPY I	Ausschüttende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse SEK A	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Ausschüttende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	88.355.473	5.383.361	166.970	2.577.819	2.835.944	36.560.035	14.724.239	3.899.770	458.405	62.869.655
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.596.736	96.351	5.464	1.872.412	1.277.803	3.706.919	834.919	677	1.532	5.314.847
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(16.460.323)	–	(65.116)	(659.013)	(697.082)	(10.636.607)	(4.938.618)	(729.578)	(144.962)	(14.915.267)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	75.491.886	5.479.712	107.318	3.791.218	3.416.665	29.630.347	10.620.540	3.170.869	314.975	53.269.235
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	90.791.421	11.045.650	248.014	2.138.768	3.108.113	51.068.297	21.313.162	5.292.052	582.573	90.250.991
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	5.483.477	122.818	45.202	994.763	742.141	4.429.875	3.699.288	–	1.348	8.834.909
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(7.919.425)	(5.785.107)	(126.246)	(555.712)	(1.014.310)	(18.938.137)	(10.288.211)	(1.392.282)	(125.516)	(36.216.245)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	88.355.473	5.383.361	166.970	2.577.819	2.835.944	36.560.035	14.724.239	3.899.770	458.405	62.869.655

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I5	Ausschüttende Klasse USD I5	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	9.453.599	13.796.794	10.271.003	462.275	2.565.820	4.240.903	1.222.416	16.556.554	1.153.935
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.798.419	1.114.455	1.600.872	–	365.525	820.671	160.057	3.883.877	981.050
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.195.711)	(11.999.779)	(10.544.431)	(71.677)	(1.171.885)	(851.911)	(341.110)	(5.493.837)	(275.056)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	9.056.307	2.911.470	1.327.444	390.598	1.759.460	4.209.663	1.041.363	14.946.594	1.859.929
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	22.169.862	10.053.832	12.404.415	541.892	1.700.784	4.959.069	1.049.439	16.647.169	2.069.373
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.607.356	10.196.253	1.738.668	17.599	964.069	522.220	348.065	3.334.781	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(14.323.619)	(6.453.291)	(3.872.080)	(97.216)	(99.033)	(1.240.386)	(175.088)	(3.425.396)	(915.438)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	9.453.599	13.796.794	10.271.003	462.275	2.565.820	4.240.903	1.222.416	16.556.554	1.153.935

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse CHF A	Thesaurierende Klasse CHF I	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	168.383	73.530	19.499	24.316	1.043.186	372.075	3.313.293	518.941	92.174	92.293
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	22.122	–	–	1.199	758.046	763	1.472.839	3.074.524	9.174	8.912
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(29.731)	(34.320)	–	(1.100)	(768.754)	(94.416)	(899.098)	(72.300)	(9.583)	(12.599)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	160.774	39.210	19.499	24.415	1.032.478	278.422	3.887.034	3.521.165	91.765	88.606
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	60.909	79.530	19.499	22.899	1.296.606	390.699	4.424.657	88.001	157.391	85.831
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	113.584	–	–	2.267	279.134	12.100	1.189.077	444.840	4.437	16.061
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(6.110)	(6.000)	–	(850)	(532.554)	(30.724)	(2.300.441)	(13.900)	(69.654)	(9.599)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	168.383	73.530	19.499	24.316	1.043.186	372.075	3.313.293	518.941	92.174	92.293

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse JPY I	Ausschüttende Klasse JPY I*	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.184.596	319.083	99.495	188.675	237.545	14.584.769	1.500.000	146.696	409.578	2.686.234
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	9.792	7.142.435	5	–	41.393	1.214.913	–	122.573	146.935	498.102
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.166.897)	(296.045)	(1.041)	(68.775)	(125.373)	(2.213.917)	–	(27.238)	(30.573)	(808.521)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	27.491	7.165.473	98.459	119.900	153.565	13.585.765	1.500.000	242.031	525.940	2.375.815
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.259.686	1.128.213	106.086	486.236	–	14.079.861	–	80.298	533.328	2.899.367
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	157.817	5	8.833	279.363	1.728.546	1.500.000	166.027	31.026	1.718.379
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(75.090)	(966.947)	(6.596)	(306.394)	(41.818)	(1.223.638)	–	(99.629)	(154.776)	(1.931.512)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.184.596	319.083	99.495	188.675	237.545	14.584.769	1.500.000	146.696	409.578	2.686.234

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Ausschüttende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I4*	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.203.389	385.271	8.546.826	317.102	7.171.291	237.376	–	2.514.199	796.656	445.414
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	34.856	–	8.965.863	22.417.004	–	16.589	281.000	–	204.183	283.518
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(224.480)	(130.226)	(9.027.453)	(52.014)	(7.065.704)	(218.858)	–	–	(727.957)	(535.590)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.013.765	255.045	8.485.236	22.682.092	105.587	35.107	281.000	2.514.199	272.882	193.342
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.111.564	434.343	7.172.968	6.141.951	8.374.379	273.202	–	–	279.280	116.292
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	145.212	–	5.316.388	83.377	–	42.153	–	2.514.199	599.751	341.786
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(53.387)	(49.072)	(3.942.530)	(5.908.226)	(1.203.088)	(77.979)	–	–	(82.375)	(12.664)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.203.389	385.271	8.546.826	317.102	7.171.291	237.376	–	2.514.199	796.656	445.414

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	776.456
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	74.483
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(444.746)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	406.193

Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	857.639
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	135.961
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(217.144)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	776.456

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Strategic Income

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	471.279	8.514.232	–	870.921	5.400	655.596	135.233	225.209	–	1.370.873
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	11.281.729	7.692.003	1.281.499	5.631.637	32.038	447.649	29.935	4.396.759	649.150	136.313.875
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.042.371)	(647.399)	(52.764)	(1.343.657)	(836)	(359.555)	(60.825)	(1.243.356)	–	(23.822.183)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	9.710.637	15.558.836	1.228.735	5.158.901	36.602	743.690	104.343	3.378.612	649.150	113.862.565
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	589.284	2.408.654	–	1.123.616	–	567.731	221.329	335.052	–	2.042.998
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.243	6.405.843	–	37.229	5.400	227.899	5.611	2.950	–	1.096.532
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(121.248)	(300.265)	–	(289.924)	–	(140.034)	(91.707)	(112.793)	–	(1.768.657)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	471.279	8.514.232	–	870.921	5.400	655.596	135.233	225.209	–	1.370.873

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungs-gesichert)	Ausschüttende Klasse JPY I CG	Ausschüttende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse JPY Z*	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse SGD A	Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	11.761.499	2.348.460	6.742.455	9.131.838	10.979.747	1.418.467	216.898	648.072	4.909.524	26.750.249
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	653.954	–	–	5.300	–	3.002.669	525.874	232.717	32.570.536	17.296.531
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.862.728)	(2.795)	(5.572.566)	(9.131.838)	(5.020.682)	(751.775)	(105.415)	(120.430)	(6.089.117)	(4.702.088)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	10.552.725	2.345.665	1.169.889	5.300	5.959.065	3.669.361	637.357	760.359	31.390.943	39.344.692
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	12.356.093	2.351.292	6.692.084	9.131.838	–	1.732.128	337.853	372.945	6.948.278	25.485.732
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	6.848.895	–	552.581	–	13.900.889	114.346	112.338	427.307	1.107.963	7.267.596
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(7.443.489)	(2.832)	(502.210)	–	(2.921.142)	(428.007)	(233.293)	(152.180)	(3.146.717)	(6.003.079)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	11.761.499	2.348.460	6.742.455	9.131.838	10.979.747	1.418.467	216.898	648.072	4.909.524	26.750.249

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.624.416	4.399.957	30.162.828	2.693.726	6.188.277	994.062	3.459.057
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.068.937	–	9.491.191	5.940.870	4.271.764	461.089	140.478
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(287.970)	(847.594)	(11.875.634)	(1.965.860)	(1.353.326)	(208.537)	(152.988)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.405.383	3.552.363	27.778.385	6.668.736	9.106.715	1.246.614	3.446.547
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.656.220	6.626.975	30.078.171	2.459.752	6.343.104	987.823	3.748.472
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	204.194	–	8.255.717	690.416	1.507.999	142.142	67.969
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(235.998)	(2.227.018)	(8.171.060)	(456.442)	(1.662.826)	(135.903)	(357.384)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.624.416	4.399.957	30.162.828	2.693.726	6.188.277	994.062	3.459.057

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield

	Thesaurierende Klasse EUR X*	Thesaurierende Klasse GBP X*	Ausschüttende Klasse GBP X*	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD X*	Thesaurierende Klasse USD Z*	Ausschüttende Klasse USD Z*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	429.777	22.390	–	1.000	1.000	1.225	–	2.408.657	721.340
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	3.032	–	–	–	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(387.077)	(18.394)	–	(1.339)	–	–	–	(2.000)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	42.700	3.996	–	2.693	1.000	1.225	–	2.406.657	721.340
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	1.000	1.000	2.498.000	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.048.830	22.390	1.022.396	–	–	1.225	5.819	3.212.677	721.340
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.619.053)	–	(1.022.396)	–	–	(2.498.000)	(5.819)	(804.020)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	429.777	22.390	–	1.000	1.000	1.225	–	2.408.657	721.340

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

	Thesaurierende Klasse CHF I	Thesaurierende Klasse CHF I4*	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR X	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse SEK A
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.034.420	456.611	63.496	45.983	24.272	56.094	57.553	4.068.252	2.158	33.205
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	215.000	–	1.263	19	2.844	1.565	14.313	–	–	1.522
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.000)	(456.611)	(57.408)	(19.340)	(4.409)	(2.524)	(3.770)	–	(1.371)	(11.761)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.247.420	–	7.351	26.662	22.707	55.135	68.096	4.068.252	787	22.966
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.121.106	943.136	213.963	47.988	32.268	61.544	63.965	4.068.252	9.545	52.436
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	272.329	–	80.000	–	2.912	727	4.837	–	–	8.746
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.359.015)	(486.525)	(230.467)	(2.005)	(10.908)	(6.177)	(11.249)	–	(7.387)	(27.977)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.034.420	456.611	63.496	45.983	24.272	56.094	57.553	4.068.252	2.158	33.205

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD M
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	85.553	518.363	69.555	1.594.074	301.029	65.000	27.458	80.293	91.458
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	27.479	22.132	–	139.711	–	–	–	70.559	4.164
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(19.821)	(153.479)	(1.982)	(424.700)	(37.580)	(25.000)	(27.458)	(64.040)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	93.211	387.016	67.573	1.309.085	263.449	40.000	–	86.812	95.622
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	457.011	568.237	106.599	1.548.109	308.361	75.000	37.058	97.693	95.176
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.945	68.018	–	1.069.743	3.408	5.000	3.400	–	14.252
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(379.403)	(117.892)	(37.044)	(1.023.778)	(10.740)	(15.000)	(13.000)	(17.400)	(17.970)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	85.553	518.363	69.555	1.594.074	301.029	65.000	27.458	80.293	91.458

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]

	Thesaurierende Klasse EUR I3*	Thesaurierende Klasse EUR I4*	Thesaurierende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR X*	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I5*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr						
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.156.822	–	249.922	7.706.142	1.000	7.267.654
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	834.545	25.687.200	–	5.776.200	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(2.208.841)	(2.361.063)	(249.922)	(5.093.698)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	782.526	23.326.137	–	8.388.644	1.000	7.267.654
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr						
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	2.183.738	–	1.368.322	8.140.270	1.000	7.267.654
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(26.916)	–	(1.118.400)	(434.128)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.156.822	–	249.922	7.706.142	1.000	7.267.654

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Tactical Macro[1]

	Thesaurierende Klasse USD I*	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD Z*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr			
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile			
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.000	32.912	2.605.310
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.000	32.912	2.605.310

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond

	Thesaurierende Klasse CHF P*	Thesaurierende Klasse CHF U	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR U	Thesaurierende Klasse EUR Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.900	66.596	53.957	5.092.957	15.867	501.554	1.640.462	806	40.833	22.356
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	3.907	186.949	3.494.687	83.255	303.369	279.617	94.643	64.043	6.774
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(14.790)	(42.032)	(2.800.141)	(46.860)	–	(232.633)	(5.534)	(5.410)	(10.100)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.900	55.713	198.874	5.787.503	52.262	804.923	1.687.446	89.915	99.466	19.030
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	20.604	88.648	6.724.282	5.457	556.414	2.214.472	252	59.498	597.498
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.900	68.248	73.875	5.559.527	10.872	202.752	149.283	566	23.401	447.028
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	(22.256)	(108.566)	(7.190.852)	(462)	(257.612)	(723.293)	(12)	(42.066)	(1.022.170)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.900	66.596	53.957	5.092.957	15.867	501.554	1.640.462	806	40.833	22.356

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr		
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	24.446	805.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	87.633	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(91.795)	(230.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	20.284	575.000
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr		
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	40.059	805.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	144.957	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(160.570)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	24.446	805.000

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies

	Thesaurierende Klasse CHF I	Thesaurierende Klasse CHF I5*	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Thesaurierende Klasse EUR I5*	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR P*	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I2
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	331.704	139.713	3.198.588	14.958.535	1.401.062	614.817	168.291	2.888.663	6.717.230	75.869.469
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	151.053	37.452	259.067	2.480.933	25.140	16.894	–	147.958	1.476.635	26.752.166
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(269.641)	(177.165)	(2.776.185)	(16.436.870)	(686.876)	(631.711)	(92.243)	(3.013.653)	(6.923.408)	(46.627.435)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	213.116	–	681.470	1.002.598	739.326	–	76.048	22.968	1.270.457	55.994.200
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	522.520	47.000	5.650.747	30.954.859	1.254.213	916.447	61.124	–	5.450.362	65.191.635
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	93.716	92.713	1.954.523	10.782.886	373.070	218.897	129.902	3.670.532	3.885.691	26.424.053
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(284.532)	–	(4.406.682)	(26.779.210)	(226.221)	(520.527)	(22.735)	(781.869)	(2.618.823)	(15.746.219)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	331.704	139.713	3.198.588	14.958.535	1.401.062	614.817	168.291	2.888.663	6.717.230	75.869.469

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I2*	Thesaurierende Klasse GBP I5	Thesaurierende Klasse GBP P	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse JPY I*	Thesaurierende Klasse SGD A*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.635	20.811.248	65.755.680	41.713	4.210.727	10.011	6.893.263	664.412	21.190.138	4.960.786
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	28.547	1.274.912	18.481.299	–	–	814.157	663.357	–	17.697.579	502.688
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(7.245)	(18.922.276)	(49.819.930)	–	(9.754)	(823.711)	(3.930.530)	(250.138)	(21.332.893)	(1.240.135)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	28.937	3.163.884	34.417.049	41.713	4.200.973	457	3.626.090	414.274	17.554.824	4.223.339
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	11.930.455	45.118.664	40.900	–	–	3.687.353	841.285	14.516.127	6.375.720
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.661	11.079.640	44.868.761	813	4.210.727	10.011	5.207.190	–	9.221.872	807.263
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(26)	(2.198.847)	(24.231.745)	–	–	–	(2.001.280)	(176.873)	(2.547.861)	(2.222.197)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.635	20.811.248	65.755.680	41.713	4.210.727	10.011	6.893.263	664.412	21.190.138	4.960.786

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I5	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD P	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.920.389	1.297.914	4.656.985	2.256.709
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	183.568	92.708	214.528	8.919
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.126.306)	(860.754)	(4.234.386)	(1.307.438)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	977.651	529.868	637.127	958.190
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr				
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile				
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.529.220	871.364	616.287	829.875
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	453.543	933.686	5.246.410	1.463.217
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(62.374)	(507.136)	(1.205.712)	(36.383)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.920.389	1.297.914	4.656.985	2.256.709

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Trading2**

	Thesaurierende Klasse EUR X*	Thesaurierende Klasse USD X*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr		
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	66.029.923	1.818.579
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	644.896	471.245
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(66.674.819)	(2.289.824)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	–	–
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr		
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	67.400.238	2.685.584
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.370.315)	(867.005)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	66.029.923	1.818.579

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.
** Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity

	Thesaurierende Klasse JPY I3*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr					
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	3.336.540	227.315	150.640	229.104	1.000
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	495.845	35.050	33.651	–	562.322
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(10.154)	(61.723)	(17.287)	–	(9.105)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.822.231	200.642	167.004	229.104	554.217
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr					
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile					
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	61.736	55.448	229.104	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.341.989	199.320	124.911	–	1.000
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.449)	(33.741)	(29.719)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.336.540	227.315	150.640	229.104	1.000

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite

	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR I4	Ausschüttende Klasse EUR I4*	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I3	Ausschüttende Klasse GBP I3	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I4*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	44.461	549.260	66.048	–	27.502	2.427.688	6.272.119	21.276.762	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	315.495	78.615	240	2.748	86	217.259	5.145.591	4.786.168	785	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(53.521)	(123.794)	(22.009)	–	(1.904)	(1.584.815)	(2.489.010)	(3.472.032)	–	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	306.435	504.081	44.279	2.748	25.684	1.060.132	8.928.700	22.590.898	785	–
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	47.525	220.080	180.864	–	33.905	1.802.720	2.248.157	3.198.627	–	846
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	11.664	425.297	422	–	–	1.340.219	4.553.797	19.638.605	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(14.728)	(96.117)	(115.238)	–	(6.403)	(715.251)	(529.835)	(1.560.470)	–	(846)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	44.461	549.260	66.048	–	27.502	2.427.688	6.272.119	21.276.762	–	–

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungs-gesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I4*	Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungs-gesichert)	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I3*	Ausschüttende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD I4
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	9.386.183	–	458.474	9.705	950.719	1.097.810	4.024.747	–	2.042.656	385.879
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	18.942	43.332	91.944	4.841	415.505	2.043.767	898.789	–	522.685	118.043
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(5.733.554)	–	(174.214)	(4.905)	(474.710)	(3.140.685)	(545.352)	–	(270.689)	(126.157)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	3.671.571	43.332	376.204	9.641	891.514	892	4.378.184	–	2.294.652	377.765
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	8.895.632	786	287.113	10.180	911.802	1.127.931	4.539.876	849	1.053.159	1.879.518
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.547.300	–	358.721	4.767	500.722	692.990	1.088.996	–	1.203.212	1.407.434
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.056.749)	(786)	(187.360)	(5.242)	(461.805)	(723.111)	(1.604.125)	(849)	(213.715)	(2.901.073)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	9.386.183	–	458.474	9.705	950.719	1.097.810	4.024.747	–	2.042.656	385.879

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr		
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	98.157	2.712.179
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	24.441	1.093.031
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(34.958)	(519.704)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	87.640	3.285.506
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr		
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	107.362	2.855.112
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	15.269	632.431
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(24.474)	(775.364)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	98.157	2.712.179

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value

	Thesaurierende Klasse EUR A*	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert)*	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I*	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert)*	Ausschüttende Klasse GBP I*	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert)*	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungs-gesichert)*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr											
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile											
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	13.958	39.526	1.468.204	3.967.984	1.436.743	11.258.613	2.528	843	2.528	843	70.274.876
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	65.490	28.220	2.417.441	18.901.030	159.284	45.314	–	54.613	29.700	657.290	10.973.706
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(22.468)	(44.244)	(958.684)	(6.285.461)	(336.837)	(722.476)	–	(3.312)	(410)	(42.080)	(9.630.756)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	56.980	23.502	2.926.961	16.583.553	1.259.190	10.581.451	2.528	52.144	31.818	616.053	71.617.826
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr											
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile											
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	13.958	39.526	1.627.094	4.250.285	1.491.188	13.047.025	2.528	843	2.528	843	73.478.088
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	–	(158.890)	(282.301)	(54.445)	(1.788.412)	–	–	–	–	(3.203.212)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	13.958	39.526	1.468.204	3.967.984	1.436.743	11.258.613	2.528	843	2.528	843	70.274.876

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungs-gesichert)*	Ausschüttende Klasse GBP P*	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungs-gesichert)*	Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse USD A*	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I4*	Thesaurierende Klasse USD I5*	Thesaurierende Klasse USD M*	Thesaurierende Klasse USD Y*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	101.890	2.678	7.624.449	5.601	6.754.569	35.996.493	5.756.675	5.300	5.176.603	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	107.842	–	3.957.303	26.432	3.474.454	23.051.960	422.550	–	1.232.124	10.023.997
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(49.068)	–	(1.516.450)	(1.307)	(3.239.667)	(24.200.529)	(1.650.663)	(800)	(4.000.711)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	160.664	2.678	10.065.302	30.726	6.989.356	34.847.924	4.528.562	4.500	2.408.016	10.023.997
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–	–	–	–	–	200.000	–	–	–	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	102.520	2.678	8.502.130	5.636	7.269.038	41.035.790	5.929.016	5.300	5.418.346	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(630)	–	(877.681)	(35)	(514.469)	(5.239.297)	(172.341)	–	(241.743)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	101.890	2.678	7.624.449	5.601	6.754.569	35.996.493	5.756.675	5.300	5.176.603	–

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.344.067
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	19.275
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.343.051)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	20.291

Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.344.067
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.344.067

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity

	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungs-gesichert)*	Ausschüttende Klasse GBP I3	Thesaurierende Klasse SGD A1	Thesaurierende Klasse USD A (PF)	Thesaurierende Klasse USD A
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	57.075	3.268.450	3.439.272	–	316.553	–	54.852	12.714	233.693	1.265.021
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	137	723.435	424.140	–	786	–	90.971	1.527	14.454	109.187
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(34.453)	(1.408.427)	(849.874)	–	(70.584)	–	(8.234)	(7.704)	(134.798)	(194.226)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	22.759	2.583.458	3.013.538	–	246.755	–	137.589	6.537	113.349	1.179.982
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	143.682	4.846.206	11.178.440	2.771	377.171	2.455	225.433	22.176	227.237	1.487.680
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	172.023	326.393	783.023	–	13.018	2.183	4.879	5.032	21.487	276.405
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(258.630)	(1.904.149)	(8.522.191)	(2.771)	(73.636)	(4.638)	(175.460)	(14.494)	(15.031)	(499.064)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	57.075	3.268.450	3.439.272	–	316.553	–	54.852	12.714	233.693	1.265.021

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A1	Ausschüttende Klasse USD I (PF)	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD U	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.094.746	2.642.224	3.674.697	1.186.852	111.946	534.775	267.357
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	89.727	807.930	1.587.062	202.787	13.482	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(214.157)	(874.484)	(3.192.984)	(472.093)	(47.685)	(446.233)	(66.319)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	970.316	2.575.670	2.068.775	917.546	77.743	88.542	201.038
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.253.410	2.802.577	2.090.293	10.442.455	109.302	542.601	419.811
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	214.886	375.719	3.885.914	1.985.919	2.738	–	75.111
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(373.550)	(536.072)	(2.301.510)	(11.241.522)	(94)	(7.826)	(227.565)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.094.746	2.642.224	3.674.697	1.186.852	111.946	534.775	267.357

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities

	Thesaurierende Klasse AUD E	Thesaurierende Klasse AUD T	Thesaurierende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR1 A	Thesaurierende Klasse EUR1 I	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse SGD A	Thesaurierende Klasse USD B
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	93.786	110.356	84.141	30.996	78.036	125.756	1.065	579.622	807.081
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	26.899	41.328	–	1.733	11.143	57.842	–	685.550	717.450
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(55.705)	(30.296)	–	(5.758)	(17.317)	(69.735)	–	(637.579)	(970.676)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	64.980	121.388	84.141	26.971	71.862	113.863	1.065	627.593	553.855
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr									
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile									
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	103.392	105.957	84.141	34.214	85.750	154.894	73.977	542.847	865.824
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	49.631	38.631	–	2.346	15.445	67.811	–	242.498	1.269.038
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(59.237)	(34.232)	–	(5.564)	(23.159)	(96.949)	(72.912)	(205.723)	(1.327.781)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	93.786	110.356	84.141	30.996	78.036	125.756	1.065	579.622	807.081

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD C2	Thesaurierende Klasse USD E	Thesaurierende Klasse USD I2*	Thesaurierende Klasse USD I3	Ausschüttende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD T	Thesaurierende Klasse USD U	Thesaurierende Klasse USD Z
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	136.170	43.555	724.570	–	883.721	215.406	464.616	950.340	2.057.222	12.941
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	612	295.828	1.000	3.330	–	116.205	557.491	–	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(18.551)	(43.632)	(378.434)	–	(224.527)	–	(218.447)	(607.473)	(420.614)	(930)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	117.619	535	641.964	1.000	662.524	215.406	362.374	900.358	1.636.608	12.011
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	175.037	61.643	713.406	–	1.368.306	275.603	2.743.383	685.660	2.287.465	11.728
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	34.603	594.543	–	3.413	–	162.523	715.901	32.378	1.213
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(38.867)	(52.691)	(583.379)	–	(487.998)	(60.197)	(2.441.290)	(451.221)	(262.621)	–
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	136.170	43.555	724.570	–	883.721	215.406	464.616	950.340	2.057.222	12.941

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD1 A	Thesaurierende Klasse USD1 I	Ausschüttende Klasse USD1 I	Thesaurierende Klasse ZAR B	Thesaurierende Klasse ZAR C2	Thesaurierende Klasse ZAR E	Thesaurierende Klasse ZAR T
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.345.397	5.765.989	174.175	171.064	2.779	247.002	219.960
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	324.075	526.299	56.274	168.398	618	260.588	110.817
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(878.437)	(2.203.372)	(56.244)	(228.788)	(3.224)	(364.110)	(150.661)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.791.035	4.088.916	174.205	110.674	173	143.480	180.116
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	2.606.938	9.791.044	254.798	146.610	7.079	239.157	165.854
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.106.851	2.335.683	26.230	242.602	233	159.012	259.962
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.368.392)	(6.360.738)	(106.853)	(218.148)	(4.533)	(151.167)	(205.856)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	2.345.397	5.765.989	174.175	171.064	2.779	247.002	219.960

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD B	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse AUD C2*	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD E	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse AUD T	Thesaurierende Klasse CHF A
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	675.732	492.551	138.287	1.807	–	245.324	121.348	462.964	368.420	139.881
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	12.444	46.222	43.342	–	–	19.919	26.286	120.444	71.826	–
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(285.769)	(209.383)	(55.885)	(1.807)	–	(40.952)	(94.274)	(127.450)	(138.280)	(37.505)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	402.407	329.390	125.744	–	–	224.291	53.360	455.958	301.966	102.376
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	547.802	528.145	159.224	9.268	4.628	226.887	131.627	370.189	348.355	145.606
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	561.190	401.435	139.425	182	744	157.592	110.452	491.866	186.159	7.970
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(433.260)	(437.029)	(160.362)	(7.643)	(5.372)	(139.155)	(120.731)	(399.091)	(166.094)	(13.695)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	675.732	492.551	138.287	1.807	–	245.324	121.348	462.964	368.420	139.881

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse SGD A	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD B
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	133.521	550.981	48.760	7.160.831	28.524	3.425.409	10.009.919	925.030	2.528.277	1.279.147
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	35.925	25.361	3.364	540.387	13.501	86.168	1.452.660	3.420	540.383	444.491
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(54.100)	(71.954)	(3.608)	(3.143.574)	(14.164)	(996.003)	(3.769.092)	(136.721)	(988.978)	(976.131)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	115.346	504.388	48.516	4.557.644	27.861	2.515.574	7.693.487	791.729	2.079.682	747.507
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	221.920	2.188.596	27.810	7.690.618	41.774	4.190.452	10.643.671	1.003.155	2.658.868	1.533.723
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	808.215	115.823	27.222	3.362.015	54.661	1.521.105	3.000.057	98.848	2.723.404	2.264.820
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(896.614)	(1.753.438)	(6.272)	(3.891.802)	(67.911)	(2.286.148)	(3.633.809)	(176.973)	(2.853.995)	(2.519.396)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	133.521	550.981	48.760	7.160.831	28.524	3.425.409	10.009.919	925.030	2.528.277	1.279.147

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse USD C2*	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD E	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD M
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.229.746	33.343	25.679	1.159.742	925.767	23.259	5.613.666	552.034	895.705	3.629.307
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	9.180	275	186.730	177.748	–	1.148.152	34.829	–	142.543
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(293.707)	(42.523)	(25.954)	(435.826)	(539.575)	–	(2.754.295)	(55.773)	(16.092)	(1.257.944)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	936.039	–	–	910.646	563.940	23.259	4.007.523	531.090	879.613	2.513.906
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.778.770	59.343	36.053	1.226.573	1.350.073	27.397	5.679.976	516.818	84.179	4.177.044
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	–	29.337	32.134	1.183.941	872.491	539	2.502.125	96.207	891.081	1.015.838
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(549.024)	(55.337)	(42.508)	(1.250.772)	(1.296.797)	(4.677)	(2.568.435)	(60.991)	(79.555)	(1.563.575)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.229.746	33.343	25.679	1.159.742	925.767	23.259	5.613.666	552.034	895.705	3.629.307

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD T	Thesaurierende Klasse USD Z	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR B	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)*	Thesaurierende Klasse ZAR C2	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR E	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR T
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr											
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile											
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.332.629	1.205.244	194.495	1.218.015	197.018	26.163	5.956	641.792	154.149	861.697	213.911
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	325.133	272.790	1.362	64.684	38.501	–	–	134.508	52.498	166.334	89.973
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(508.228)	(419.921)	(123.096)	(281.025)	(138.514)	(26.163)	(4.180)	(257.427)	(71.735)	(241.390)	(139.919)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.149.534	1.058.113	72.761	1.001.674	97.005	–	1.776	518.873	134.912	786.641	163.965
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr											
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile											
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.360.408	1.316.547	442.390	1.178.531	209.941	51.876	6.127	718.416	124.544	799.891	158.545
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	1.053.254	1.224.710	281	1.079.663	209.050	11.624	154	1.475.483	162.432	572.158	221.048
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.081.033)	(1.336.013)	(248.176)	(1.040.179)	(221.973)	(37.337)	(325)	(1.552.107)	(132.827)	(510.352)	(165.682)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	1.332.629	1.205.244	194.495	1.218.015	197.018	26.163	5.956	641.792	154.149	861.697	213.911

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap

	Thesaurierende Klasse AUD B	Thesaurierende Klasse AUD C2	Thesaurierende Klasse AUD E	Thesaurierende Klasse AUD T	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungs-gesichert)*
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	108.173	1.690	97.829	111.847	148.159	29.210	189.681	211.363	1.467.828	3.871.698
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	66.284	–	59.405	27.859	8.459	10.000	215.043	80.862	170.598	739.200
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(29.129)	(680)	(34.911)	(22.119)	(73.780)	(12.762)	(60.222)	(31.997)	(1.119.218)	(123.000)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	145.328	1.010	122.323	117.587	82.838	26.448	344.502	260.228	519.208	4.487.898
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	140.649	1.166	118.110	100.934	176.331	17.463	656.580	271.757	1.299.867	–
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	128.598	680	27.564	58.608	80.686	14.654	365.442	577.331	251.023	7.311.198
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(161.074)	(156)	(47.845)	(47.695)	(108.858)	(2.907)	(832.341)	(637.725)	(83.062)	(3.439.500)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	108.173	1.690	97.829	111.847	148.159	29.210	189.681	211.363	1.467.828	3.871.698

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z	Ausschüttende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD C2	Thesaurierende Klasse USD E	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	13.758	18.895	901.455.981	3.946.798	658.004	388.279	3.384	161.293	8.382.330	1.118.497
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	11.023	374	116.852.155	632.739	16.607	897.834	330	387.845	2.375.399	88.468
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(3.716)	–	(273.717.702)	(915.725)	(42.088)	(856.669)	(3.560)	(281.426)	(3.202.110)	(158.449)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	21.065	19.269	744.590.434	3.663.812	632.523	429.444	154	267.712	7.555.619	1.048.516
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr										
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile										
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	9.727	18.640	1.123.196.288	6.258.516	727.056	460.497	7.917	358.092	7.891.915	1.485.829
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	4.123	255	232.598.449	553.685	78.375	595.156	12.727	176.074	3.782.275	101.087
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(92)	–	(454.338.756)	(2.865.403)	(147.427)	(667.374)	(17.260)	(372.873)	(3.291.860)	(468.419)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	13.758	18.895	901.455.981	3.946.798	658.004	388.279	3.384	161.293	8.382.330	1.118.497

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD M	Thesaurierende Klasse USD T	Thesaurierende Klasse USD Z	Thesaurierende Klasse ZAR E	Thesaurierende Klasse ZAR T
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr						
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	7.496	177.791	364.357	120.834	81.361	96.280
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	189	115.791	256.086	1.462	19.771	36.544
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(244)	(64.523)	(284.517)	(37.729)	(68.514)	(58.550)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.441	229.059	335.926	84.567	32.618	74.274
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr						
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile						
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	5.040	3.928.128	337.309	145.644	75.771	133.102
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	7.022	80.513	213.833	–	49.994	73.599
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(4.566)	(3.830.850)	(186.785)	(24.810)	(44.404)	(110.421)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.496	177.791	364.357	120.834	81.361	96.280

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

5. ANTEILKAPITAL (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value

	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungs-gesichert)	Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungs-gesichert)*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2*	Thesaurierende Klasse USD M
Für das am 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	4.206.288	1.414.380	–	461.520	5.064.335	3.900.000	31.526
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.974.667	551.054	633.142	76.050	1.935.998	3.228.340	739
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(1.057.070)	(131.482)	–	(119.624)	(904.660)	–	(8.917)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	7.123.885	1.833.952	633.142	417.946	6.095.673	7.128.340	23.348
Für das am 31. Dezember 2022 beendete Geschäftsjahr							
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile							
Anteile im Umlauf zu Beginn des Geschäftsjahres	1.966.688	882.278	–	374.861	4.798.391	–	28.431
Ausgegebene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	3.144.051	636.778	–	168.042	838.670	3.900.000	5.075
Zurückgenommene rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	(904.451)	(104.676)	–	(81.383)	(572.726)	–	(1.980)
Anteile im Umlauf am Ende des Geschäftsjahres	4.206.288	1.414.380	–	461.520	5.064.335	3.900.000	31.526

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.
[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE

Der Manager hat für jede Klasse Anspruch auf eine Gebühr in Bezug auf Managementdienste, die er für jedes Portfolio erbringt (die „Managementgebühr"). Darüber hinaus hat der Manager Anspruch auf eine Gebühr von 0,025 % in Bezug auf die von ihm der Gesellschaft bereitgestellten administrativen Supportdienste.

Die maximale jährliche Gebühr, die der Gesellschaft in Bezug auf ein Portfolio in Rechnung gestellt wird, beträgt 2,5 % seines NIW. Die aktuelle Managementgebühr, die in Bezug auf jedes Portfolio zahlbar ist, wird im betreffenden Nachtrag veröffentlicht. Die aktuellen Sätze für die Managementgebühr der einzelnen Anlageklassen sind nachstehend aufgeführt.

Die Managementgebühr läuft täglich auf und ist monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats zahlbar. Sofern im Nachtrag des betreffenden Portfolios keine anders lautenden Angaben gemacht werden, bezahlt der Manager die in Bezug auf ein Portfolio bestellten Sub-Investment-Manager oder Anlageberater aus seiner Managementgebühr. Der Manager hat ferner Anspruch auf Erstattung aller Spesen durch die Gesellschaft, die ihm (oder seinen Beauftragten) bei der Erfüllung seiner (ihrer) Pflichten entstehen, und zahlt diese erstatteten Spesen an den jeweiligen Dienstleister.

5G Connectivity	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse AUD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse AUD I2	0,68 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,70 %
Thesaurierende Klasse CHF I	0,85 %
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,68 %
Thesaurierende Klasse CNY A	1,70 %
Thesaurierende Klasse CNY I2	0,68 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,85 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,85 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,68 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,43 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,70 %
Thesaurierende Klasse GBP A	1,70 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,85 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,68 %
Thesaurierende Klasse HKD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse HKD I2	0,68 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse SGD I2	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD E	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,43 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse ZAR A	1,70 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	1,80 %

China A-Share Equity	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse CNY I	0,90 %
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	0,90 %
Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	0,90 %

China Bond	
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,30 %
Ausschüttende Klasse CNY I	0,65 %
Thesaurierende Klasse CNY Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,52 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert)	1,30 %
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	0,65 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	0,00 %

China Equity	
Thesaurierende Klasse CHF I	1,10 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,85 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,10 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Ausschüttende Klasse GBP A	1,85 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,85 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,85 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,85 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,10 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,88 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,85 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,45 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Climate Innovation	
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Climate Innovation (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse USD I5	0,43 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

CLO Income	
Thesaurierende Klasse EUR A	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,75 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,60 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse SEK I	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I5	0,38 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Commodities	
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,65 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,33 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,65 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,33 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Corporate Hybrid Bond	
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse CHF P	0,57 %
Ausschüttende Klasse CHF P	0,57 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,48 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,42 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,30 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,20 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR P	0,57 %
Ausschüttende Klasse EUR P	0,57 %

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse GBP I	0,60 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,48 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,57 %
Ausschüttende Klasse GBP P	0,57 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,48 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,57 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Developed Market FMP – 2027	
Thesaurierende Klasse EUR A	0,65 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD A	0,65 %
Ausschüttende Klasse USD A	0,65 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,30 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,40 %
Ausschüttende Klasse USD X	0,40 %

Emerging Market Debt - Hard Currency	
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,40 %
Ausschüttende Klasse AUD I	0,70 %
Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)	0,49 %
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,56 %
Thesaurierende Klasse CHF P	0,67 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,40 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,40 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,56 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)	Management-gebühr
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,56 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,49 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,42 %
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,35 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,40 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,40 %
Thesaurierende Klasse EUR P	0,67 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,70 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,56 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,56 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,67 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,40 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,70 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,40 %
Thesaurierende Klasse SEK I2	0,56 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,40 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,40 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,70 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,56 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,56 %
Ausschüttende Klasse USD I3	0,49 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,40 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,67 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,47 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Emerging Market Debt - Local Currency	
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD B	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD C2	1,80 %
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD E	1,80 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,80 %

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse EUR I	0,75 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,75 %
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	0,60 %
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,45 %
Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)	0,36 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,75 %
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,45 %
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,45 %
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	0,36 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,50 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD B	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD E	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,38 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,38 %
Thesaurierende Klasse USD Y	0,36 %
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	1,80 %
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	1,80 %
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	1,80 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,80 %

Emerging Market Debt Blend	
Ausschüttende Klasse AUD I3	0,49 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,40 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,70 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Thesaurierende Klasse AUD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,50 %

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)	Management-gebühr
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,56 %
Ausschüttende Klasse EUR I3	0,49 %
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,42 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,35 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,40 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,40 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,70 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,67 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,67 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse NOK U	1,05 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,40 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,40 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,56 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,35 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,40 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	
Thesaurierende Klasse AUD I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse NOK I	0,60 %
Thesaurierende Klasse NOK I3	0,42 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Emerging Markets Equity	
Thesaurierende Klasse AUD B	2,00 %
Thesaurierende Klasse AUD C2	2,00 %
Thesaurierende Klasse AUD E	2,00 %
Thesaurierende Klasse AUD T	2,00 %
Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)	1,00 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,56 %

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)	Management-gebühr
Ausschüttende Klasse CAD I2	0,80 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,00 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,00 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse GBP I	1,00 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD B	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD C2	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD T	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	2,00 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	2,00 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,00 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	2,00 %

Euro Bond	
Thesaurierende Klasse EUR I	0,35 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,35 %

Euro Bond Absolute Return	
Thesaurierende Klasse EUR I	0,45 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,45 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,23 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

European High Yield Bond	
Thesaurierende Klasse CHF I	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,48 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,30 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR X	0,20 %
Thesaurierende Klasse EUR Y	0,10 %
Ausschüttende Klasse EUR Y	0,10 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,20 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

European Sustainable Equity	
Ausschüttende Klasse EUR A	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,60 %
Ausschüttende Klasse EUR I3	0,42 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,30 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)	1,50 %

Event Driven	
Thesaurierende Klasse EUR I	1,00 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,50 %
Ausschüttende Klasse GBP I5	0,50 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,95 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,50 %

Global Bond	
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	0,75 %
Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	0,20 %
Thesaurierende Klasse USD C1	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	0,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,20 %
Thesaurierende Klasse USD M	0,40 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	0,75 %

Global Diversified Income FMP – 2024	
Thesaurierende Klasse EUR A	0,75 %
Ausschüttende Klasse EUR A	0,75 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,35 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,35 %
Ausschüttende Klasse HKD A	0,75 %
Ausschüttende Klasse SGD A	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD A	0,75 %

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)	Management-gebühr
Ausschüttende Klasse USD A	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,35 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,35 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,40 %
Ausschüttende Klasse USD X	0,40 %

Global Equity Megatrends	
Thesaurierende Klasse EUR I	0,85 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,70 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,81 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Global Flexible Credit Income	
Thesaurierende Klasse CAD I5	0,30 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,20 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Global SDG Engagement	
Ausschüttende Klasse AUD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse CHF I4	0,37 %
Ausschüttende Klasse CHF I4	0,37 %
Thesaurierende Klasse CHF X	1,10 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,37 %
Ausschüttende Klasse EUR I4	0,37 %
Thesaurierende Klasse EUR X	1,10 %
Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)	0,10 %
Thesaurierende Klasse GBP I4	0,37 %
Thesaurierende Klasse GBP X	1,10 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Global SDG Engagement (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse USD I4	0,37 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,10 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Global Investment Grade Credit	
Thesaurierende Klasse EUR I	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,10 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Global Opportunistic Bond	
Thesaurierende Klasse EUR I	0,30 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,29 %
Thesaurierende Klasse USD A	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,30 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,24 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Global Real Estate Securities	
Thesaurierende Klasse EUR M	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	0,00 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD CI	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD I5	0,38 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Global Sustainable Equity	
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,30 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	0,00 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,60 %
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %

Global Sustainable Equity (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Global Sustainable Value	
Thesaurierende Klasse EUR M	0,90 %
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	0,23 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,43 %
Thesaurierende Klasse USD A	0,90 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,45 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,32 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

High Yield Bond	
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse AUD A	1,20 %
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD B	1,80 %
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	1,80 %
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD E	1,80 %
Ausschüttende Klasse AUD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,80 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,80 %
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,20 %
Thesaurierende Klasse CHF I	0,60 %
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,50 %
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,20 %
Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)	0,60 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,20 %
Ausschüttende Klasse EUR A	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,50 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,50 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse GBP A	1,20 %
Ausschüttende Klasse GBP A	1,20 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse GBP I	0,60 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,60 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,50 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,50 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,20 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD B	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD C	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD C1	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD C2	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD E	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,50 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,50 %
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	0,36 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,57 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)	0,90 %
Thesaurierende Klasse USD U	0,90 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	1,80 %
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	1,80 %
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	1,80 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,80 %

InnovAsia 5G	
Thesaurierende Klasse CHF I4	0,51 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,51 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR X	1,45 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse SGD I4	0,51 %
Thesaurierende Klasse SGD X	1,45 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,51 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,45 %

Japan Equity Engagement	
Ausschüttende Klasse EUR I5	0,43 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,43 %
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	0,43 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,81 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,85 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,85 %
Thesaurierende Klasse JPY I5	0,43 %
Thesaurierende Klasse JPY Z	0,00 %

Macro Opportunities FX	
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse SEK I	0,60 %
Ausschüttende Klasse SEK I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Next Generation Mobility	
Thesaurierende Klasse EUR A	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,85 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,85 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse USD C1	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,55 %

Next Generation Space Economy	
Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %

Responsible Asian Debt - Hard Currency	
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	0,36 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,36 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	1,10 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,10 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Short Duration Emerging Market Debt	
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,00 %
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	1,00 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,00 %
Ausschüttende Klasse CHF A	1,00 %
Thesaurierende Klasse CHF I	0,50 %
Ausschüttende Klasse CHF I	0,50 %
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,40 %
Ausschüttende Klasse CHF I2	0,40 %
Thesaurierende Klasse CHF I5	0,25 %
Thesaurierende Klasse CHF P	0,48 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,00 %
Ausschüttende Klasse EUR A	1,00 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,50 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,50 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,40 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,40 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,25 %

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse EUR M	1,00 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,00 %
Thesaurierende Klasse EUR P	0,48 %
Thesaurierende Klasse EUR U	0,75 %
Ausschüttende Klasse EUR X	0,40 %
Thesaurierende Klasse GBP A	1,00 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,50 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,50 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,40 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,40 %
Ausschüttende Klasse GBP I5	0,25 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,48 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,50 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,50 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,00 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,00 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,00 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,00 %
Ausschüttende Klasse USD C1	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,50 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,40 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,25 %
Ausschüttende Klasse USD I5	0,25 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,00 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Short Duration High Yield SDG Engagement	
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,20 %
Thesaurierende Klasse CHF I	0,60 %
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,20 %
Ausschüttende Klasse EUR A	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,50 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,20 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)	Management-gebühr
Ausschüttende Klasse EUR M	1,20 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,60 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,60 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,50 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,50 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,60 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,60 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,50 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,36 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Strategic Income	
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,00 %
Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)	0,00 %
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,00 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,00 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,00 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,50 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,00 %
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	1,00 %
Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)	0,50 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,00 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,50 %
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	0,50 %
Ausschüttende Klasse JPY I CG	0,50 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,50 %
Thesaurierende Klasse JPY Z	0,00 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,00 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,00 %
Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)	0,50 %

Strategic Income (Fortsetzung)	Management-gebühr
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,00 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,50 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,00 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Sustainable Asia High Yield	
Thesaurierende Klasse EUR X	0,40 %
Thesaurierende Klasse GBP X	0,40 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Ausschüttende Klasse USD Z	0,00 %

Sustainable Emerging Market Corporate Debt	
Thesaurierende Klasse CHF I	0,80 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,60 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,80 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,48 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,60 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,60 %
Thesaurierende Klasse EUR X	0,46 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,80 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,60 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,60 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,60 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,80 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,64 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,60 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,60 %

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,49 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,42 %
Thesaurierende Klasse EUR X	0,35 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,35 %

Tactical Macro	
Thesaurierende Klasse USD I	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Ultra Short Term Euro Bond	
Thesaurierende Klasse CHF P	0,18 %
Thesaurierende Klasse CHF U	0,29 %
Thesaurierende Klasse EUR A	0,38 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,19 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,19 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,15 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,09 %
Thesaurierende Klasse EUR M	0,38 %
Thesaurierende Klasse EUR U	0,29 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,19 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

Uncorrelated Strategies	
Thesaurierende Klasse CHF I	0,75 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,75 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR P	0,71 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,75 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,60 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,60 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,38 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,71 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,75 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,60 %

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse USD I5	0,38 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,71 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

US Equity	
Thesaurierende Klasse JPY I3	0,53 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %

US Equity Index PutWrite	
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %
Ausschüttende Klasse EUR I3	0,42 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,36 %
Ausschüttende Klasse EUR I4	0,36 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,20 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,60 %
Thesaurierende Klasse GBP I3	0,42 %
Ausschüttende Klasse GBP I3	0,42 %
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	0,42 %
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,36 %
Ausschüttende Klasse GBP I4	0,36 %
Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,57 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I3	0,42 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,36 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

US Large Cap Value	
Thesaurierende Klasse EUR A	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,42 %
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,35 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse GBP I	0,70 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,42 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,67 %
Ausschüttende Klasse GBP P	0,67 %
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	0,63 %
Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	0,63 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I4	0,42 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,35 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD Y	0,63 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

US Long Short Equity	
Thesaurierende Klasse EUR A	2,25 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,35 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,95 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,25 %
Ausschüttende Klasse GBP I3	0,95 %
Thesaurierende Klasse SGD A1	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD A (PF)	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,25 %
Thesaurierende Klasse USD A1	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD I (PF)	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,35 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,95 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,25 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %

US Multi Cap Opportunities	
Thesaurierende Klasse AUD E	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,50 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR1 A	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR1 I	0,85 %
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	0,50 %

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse SGD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD B	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD C2	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD E	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,50 %
Ausschüttende Klasse USD I3	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,25 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse USD1 A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD1 I	0,85 %
Ausschüttende Klasse USD1 I	0,85 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,80 %

US Real Estate Securities	
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,50 %
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD B	1,80 %
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD E	1,80 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,50 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,75 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,50 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,50 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD B	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD E	1,80 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)	Management-gebühr
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,54 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,50 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	1,80 %
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	1,80 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,80 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,80 %

US Small Cap	
Thesaurierende Klasse AUD B	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD C2	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD E	1,80 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,85 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,85 %
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	0,68 %
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,51 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,70 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,00 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD B	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD C2	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD E	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,00 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	1,80 %

US Small Cap (Fortsetzung)	Management-gebühr
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,80 %

US Small Cap Intrinsic Value	
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,85 %
Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)	0,68 %
Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,70 %

Gegebenenfalls wird auf die o. g. Gebühren ein Rabatt eingeräumt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Der Manager kann auf seine Gebühren verzichten, um die Gesamtkostenquoten („TERs") der Portfolios nach oben zu begrenzen. Diese Gebührenverzichte sind freiwillig und können vom Manager jederzeit ohne vorherige Mitteilung zurückgenommen werden. Gebühren, auf die freiwillig verzichtet wurde, können nicht vom Manager zurückgefordert werden. Eine Aufgliederung der TERs der einzelnen Portfolios ist in Anhang I enthalten.

Die Gesellschaft bezahlt Verwaltungsgebühren, die nicht mehr als 0,20 % des NIW des betreffenden Portfolios betragen werden. Die Verwaltungsgebühr setzt sich zusammen aus einer Gebühr, die an die Verwaltungsstelle für die von ihr in Bezug auf jedes Portfolio erbrachten Verwaltungsdienste zu zahlen ist, und einer Gebühr, die an den Manager für die von ihm für jedes Portfolio erbrachten administrativen Supportdienste zu zahlen ist; sie läuft monatlich auf und ist monatlich rückwirkend zu zahlen.

Der Fonds zahlt/zahlte an die Verwaltungsstelle Verwaltungsgebühren auf der Grundlage der Bewertung des Nettovermögens des Uncorrelated Strategies und Uncorrelated Trading am Monatsende mit den folgenden Sätzen:

Vermögenswerte von 0 – 500 Mio. US$	0,055 %
Vermögenswerte von 500 – 2.000 Mio. US$	0,05 %
Vermögenswerte über 2.000 Mio. US$	0,04 %

Der Fonds zahlt an die Verwaltungsstelle Verwaltungsgebühren auf der Grundlage des Nettoinventarwertes am Monatsende, und zwar für jedes von der Verwaltungsstelle verwaltete Portfolio und mit den folgenden Sätzen:

Vermögenswerte von 0 – 25.000 Mio. US$	0,008 %
Vermögenswerte über 25.000 Mio. US$	0,005 %

Die oben genannten Gebühren unterliegen einer monatlichen Mindestgebühr von 4.000 US$ pro Portfolio und umfassen vier Anteilklassen pro Portfolio. Bei Portfolios, die mehr als vier Anteilklassen haben, wird für jede zusätzliche Anteilklasse eine monatliche Gebühr von 150 US$ erhoben.

Darüber hinaus hat die Verwaltungsstelle Anspruch auf eine weitere Gebühr in Bezug auf die Transferstellendienste, die sie für das Portfolio erbringt.

In Bezug auf Anteile der Klassen B, C, E, C1 und C2 des jeweiligen Portfolios hat/haben der Manager und/oder die betreffende Vertriebsstelle für ihre Vertriebsdienstleistungen, die er/sie für diese Klassen erbringt/erbringen, Anspruch auf eine Vertriebsgebühr zu einem jährlichen Satz von 1,00 % des NIW der betreffenden Klassen. Diese wird taggenau berechnet und monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats gezahlt. In Bezug auf Anteile der Klasse M des jeweiligen Portfolios hat/haben der Manager und/oder die betreffende Vertriebsstelle für seine/ihre Vertriebsdienstleistungen, die er/sie für diese Klassen erbringt/erbringen, Anspruch auf eine Vertriebsgebühr zu einem jährlichen Satz in Höhe eines Prozentsatzes des NIW der jeweiligen Klasse. Diese wird taggenau berechnet und monatlich rückwirkend am Ende eines jeden Kalendermonats gezahlt. Der Satz für diese Vertriebsgebühr variiert zwischen den Portfolios und ist im Nachtrag für die einzelnen Portfolios aufgeführt. In Bezug auf alle anderen Klassen kann der Manager der Vertriebstelle für ihre Vertriebsdienste eine Gebühr (zu normalen kommerziellen Sätzen) zahlen, die ebenfalls durch Managementgebühr abgedeckt wird.

Gebühren der nicht verbundenen Unterberater

Die an die vom Manager und/oder Sub-Investment-Manager ernannten nicht verbundenen Unterberater gezahlten Gebühren werden mit Ausnahme der Green Court Capital Management Limited und den Unterberatern zu Uncorrelated Strategies aus dem Portfoliovermögen bestritten. Die insgesamt an alle Berater gezahlten Gebühren lagen zwischen 0,65 % und 1,50 % des NIW des Portfolios. Die aggregierten Beratungsgebühren für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 betrugen 1.145.544 US$ (31. Dezember 2022: 1.622.785 US$).

Erfolgsabhängige Gebühren

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wird eine erfolgsabhängige Gebühr für den US Long Short Equity, den Global SDG Engagement, den Event Driven, den Tactical Macro, den Uncorrelated Strategies und den Uncorrelated Trading berechnet.

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr
Der Manager und ein Sub-Investment-Manager haben unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr (die „erfolgsabhängige Gebühr") die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr. Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer Anteilklasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des unten für jedes Portfolio definierten Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)
Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und Anteilinhabern somit eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Wird der Managementvertrag in einem beliebigen Jahr vor Ende des Berechnungszeitraums beendet oder dem Sub-Investment-Manager gekündigt, dann wird die erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf den laufenden Berechnungszeitraum so berechnet und ausbezahlt, als ob das Datum, zu dem dieser Vertrag beendet wird, dem Ende des betreffenden Berechnungszeitraums entspräche.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager oder einen Sub-Investment-Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager oder einen Sub-Investment-Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager oder einen Sub- Investment-Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr verwendete Methode für jedes betreffenden Portfolio gestaltet sich wie folgt:

US Long Short Equity

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist.

Definitionen

Berechnungszeitraum	Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass: • im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht; • im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und • im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet. Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.
Festlegung (Kristallisierung)	Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.
High Water Mark (Höchstmarke)	Ist entweder (i) der Erstangebotspreis je Anteil oder (ii) der NIW je Anteil am Ende des vorherigen Berechnungszeitraums, in Bezug auf den eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, je nachdem, welcher Wert höher ist.

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse fällig, wenn der NIW je Anteil am Ende des Berechnungszeitraums die High Water Mark für diese spezielle PF-Klasse übersteigt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im NIW je Anteil im Berechnungszeitrum das der High Water Mark übersteigt. Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag auf und bildet Teil des NIW je Anteil für jede PF-Klasse, wo zutreffend. Jede an einem Handelstag aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr wird von einem am folgenden Handelstag erfolgten Zuwachs bis zum letzten Handelstag des Berechnungszeitraums ersetzt.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten NIW je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Eine erfolgsabhängige Gebühr wird erst gezahlt, wenn der NIW je Anteil die High Water Mark überschreitet, und derlei Gebühr wird nur bei einer Outperformance des über die Hurdle Rate (Mindestrendite) hinausgehenden NIW je Anteil, wie vorstehend beschrieben, zahlbar.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Methode (Fortsetzung)

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 verdiente der Manager eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe von 284.324 US$ (31. Dezember 2022: null USD).

Global SDG Engagement

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist.

Definitionen

Benchmark	ICE BofA Global High Yield Constrained Index in der entsprechenden Klassenwährung (wie nachstehend beschrieben)
Berechnungszeitraum	Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass: • im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht; • im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und • im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet. Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.
Festlegung (Kristallisierung)	Der Punkt, an dem eine nicht ausgleichende erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umwandelt.
Outperformance	Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des NIW je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Global SDG Engagement (Fortsetzung)

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse bei einer Outperformance, d. h. einer überdurchschnittlich positiven Entwicklung des NIW je Anteil gegenüber der Performance der für diese spezielle PF-Klasse im Berechnungszeitraum geltenden Benchmark, fällig. Die prozentuale Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 20 % der für diese spezielle PF-Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten NIW je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Für den Fall, dass die Performance einer PF-Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese PF-Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die PF-Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese PF-Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der NIW je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmark-Wert für den nächsten Berechnungszeitraum dem NIW in Bezug auf die PF-Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h., wenn der NIW 110 entsprechen würde, läge der Benchmark-Wert ebenfalls bei 110.

Benchmarkindizes

Klassen	Index	Code
USD PF-Klassen:	ICE BofA Global High Yield Constrained Index	HW0C ausgewählte Währung USD
Abgesicherte PF-Klassen EUR	ICE BofA Global High Yield Constrained Index – in EUR abgesichert	HW0C ausgewählte Währung EUR
Abgesicherte PF-Klassen GBP	ICE BofA Global High Yield Constrained Index – in GBP abgesichert	HW0C ausgewählte Währung GBP

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der NIW ihrer Anteile zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt werden kann, auch wenn der NIW ihrer Anteile gleichgeblieben oder zurückgegangen ist. Dies ist unter Umständen der Fall, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende eines Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im NIW auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle überprüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Manager gezahlt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Event Driven

Der Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

Berechnungszeitraum	Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass: • im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder PF-Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember geht; • im Fall der Auflösung einer PF-Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und • im Fall der Auflösung des Managementvertrags während eines Jahres der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet. Der erste Wert, auf dessen Grundlage die erste erfolgsabhängige Gebühr für alle PF-Klassen ermittelt wird, ist der Erstangebotspreis.
Festlegung (Kristallisierung)	Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder am Ende des Berechnungszeitraums oder an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.
High Water Mark (Höchstmarke)	Ist entweder (i) der Erstangebotspreis je Anteil oder (ii) der NIW je Anteil am Ende des vorherigen Berechnungszeitraums, in Bezug auf den eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, je nachdem, welcher Wert höher ist.

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf jede im Umlauf befindliche PF-Klasse fällig, wenn der NIW je Anteil am Ende des Berechnungszeitraums die High Water Mark (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) für diese spezielle PF-Klasse übersteigt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im Nettoinventarwert je Anteil im Berechnungszeitrum das der High Water Mark übersteigt, mit Ausnahme der Klassen I5, für die die erfolgsabhängige Gebühr 15 % des Betrags, um den das prozentuale Wachstum im Nettoinventarwert je Anteil im Berechnungszeitrum das der High Water Mark übersteigt, entspricht.

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag auf und bildet Teil des Nettoinventarwerts je Anteil für jede PF-Klasse, wo zutreffend. Jede an einem Handelstag aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr wird von einem am folgenden Handelstag erfolgten Zuwachs bis zum letzten Handelstag des Berechnungszeitraums ersetzt.

In allen Fällen erfolgte beim zur Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr angewandten Nettoinventarwert je Anteil keine vorherige Verwässerungsanpassung, d. h. er enthält keine Swing-Pricing-Anpassung.

Es wird keine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt, wenn der Nettoinventarwert je Anteil die High Water Mark überschreitet, und derlei Gebühr wird nur bei einer Outperformance des über die High Water Mark hinausgehenden Nettoinventarwerts je Anteil, wie vorstehend beschrieben, zahlbar.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Event Driven (Fortsetzung)

Methode (Fortsetzung)

Die erfolgsabhängige Gebühr läuft an jedem Handelstag im Nettoinventarwert auf und ist gewöhnlich an den Manager rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen am Ende eines jeden Berechnungszeitraums zu zahlen. Im Falle von während des Berechnungszeitraums zurückgenommenen Anteilen ist die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Anteile jedoch an den Manager innerhalb von 30 Geschäftstagen des Rücknahmedatums zahlbar.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben in der betreffenden PF-Klasse (partizipieren jedoch nicht an darauffolgenden Gewinnen und Verlusten der betreffenden Klasse), bis sie an den Manager gezahlt werden, und werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen der betreffenden PF-Klasse herangezogen oder zur Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Die Direktoren können mit Zustimmung des Managers die erfolgsabhängige Gebühr, die von einer PF-Klasse zu zahlen ist, reduzieren. Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 verdiente der Manager eine erfolgsabhängige Gebühr in Höhe von 1.269.230 US$ (31. Dezember 2022: 89.185 US$).

Tactical Macro

Der Sub-Investment-Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

Berechnungszeitraum	Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass: • im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember des folgenden Jahres geht; • im Fall der Auflösung einer Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und • im Fall der Auflösung des Vertrags des Sub-Investment-Managers während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.
Festlegung (Kristallisierung)	Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Sub-Investment-Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) bei Beendigung der Bestellung des Sub-Investment-Managers oder (iii) an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.
Outperformance	Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Tactical Macro (Fortsetzung)

Benchmarkindizes

Klassen	Index
USD-Klassen	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)
Abgesicherte Klassen EUR	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - EUR Hedged)
Abgesicherte Klassen GBP	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - GBP Hedged)
Abgesicherte Klassen CHF	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - CHF Hedged)
Abgesicherte Klassen JPY	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - JPY Hedged)

Die Benchmark ist ein weit verbreiteter Richtwert für kurzfristige Zinssätze, der einen Anhaltspunkt für die Durchschnittskurse liefert, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankenkredite aufnehmen können.

Für Klassen, die in anderen als die oben genannten Währungen denominiert sind, wird der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) die Benchmark sein. Der Index ist gegenüber der jeweiligen Klassenwährung abgesichert und stellt für die Anleger dieser Klassen eine besser geeignete Vergleichsgröße dar.

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird bzgl. jeder ausgegebenen Klasse eine erfolgsabhängige Gebühr für eine Outperformance fällig, d. h. die überdurchschnittlich positive Wertentwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) gegenüber der Wertentwicklung der für die jeweilige Klasse geltenden Benchmark während des Berechnungszeitraums. Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht bis zu 20 % der für diese spezielle Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

Für den Fall, dass die Performance einer Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der Nettoinventarwert je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmarkwert für den nächsten Berechnungszeitraum dem Nettoinventarwert in Bezug auf die Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h. wenn der Nettoinventarwert am Ende eines Berechnungszeitraums, in dem eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, 110 betragen würde, würde der Benchmarkwert zu Beginn des folgenden Berechnungszeitraums ebenfalls 110 betragen.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der Nettoinventarwert je Anteil zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird, und da in Bezug auf die erfolgsabhängige Gebühr kein Series Accounting Anwendung findet ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert je Anteil berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing" sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing" des Verkaufsprospekts enthalten).

Die erfolgsabhängige Gebühr wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an den Sub-Investment-Manager gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben im Portfolio, bis sie an den Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des Portfolios. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des Portfolios oder des Fonds (außer den an den Sub-Investment-Manager zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Tactical Macro (Fortsetzung)

Methode (Fortsetzung)

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Sub-Investment-Manager gezahlt.

Uncorrelated Strategies

Der Sub-Investment-Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen in Bezug auf jede PF-Klasse des betreffenden Portfolios zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

Berechnungszeitraum	Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass: • im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember des folgenden Jahres geht; • im Fall der Auflösung einer Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und • im Fall der Auflösung des Vertrags des Sub-Investment-Managers während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.
Festlegung (Kristallisierung)	Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Sub-Investment-Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) bei Beendigung der Bestellung des Sub-Investment-Managers oder (iii) an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.
Outperformance	Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Benchmarkindizes

Klassen	Index
USD-Klassen	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)
Abgesicherte Klassen EUR	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - EUR Hedged)
Abgesicherte Klassen GBP	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - GBP Hedged)
Abgesicherte Klassen CHF	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - CHF Hedged)
Abgesicherte Klassen JPY	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return - JPY Hedged)

Die Benchmark ist ein weit verbreiteter Richtwert für kurzfristige Zinssätze, der einen Anhaltspunkt für die Durchschnittskurse liefert, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankenkredite aufnehmen können.

Für Klassen, die in anderen als die oben genannten Währungen denominiert sind, wird der ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD) die Benchmark sein. Der Index ist gegenüber der jeweiligen Klassenwährung abgesichert.

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird bzgl. jeder ausgegebenen Klasse eine erfolgsabhängige Gebühr für eine Outperformance fällig, d. h. die überdurchschnittlich positive Wertentwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) gegenüber der Wertentwicklung der für die jeweilige Klasse geltenden Benchmark während des Berechnungszeitraums. Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht bis zu 20 % der für diese spezielle Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

Für den Fall, dass die Performance einer Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst; dieser Prozess gewährleistet, dass der Nettoinventarwert je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmarkwert für den nächsten Berechnungszeitraum dem Nettoinventarwert in Bezug auf die Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h. wenn der Nettoinventarwert am Ende eines Berechnungszeitraums, in dem eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, 110 betragen würde, würde der Benchmarkwert zu Beginn des folgenden Berechnungszeitraums ebenfalls 110 betragen.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der Nettoinventarwert je Anteil zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert je Anteil berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing" sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing" des Verkaufsprospekts enthalten).

Die erfolgsabhängige Gebühr wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an den Sub-Investment-Manager gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben im Portfolio, bis sie an den Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des Portfolios. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des Portfolios oder des Fonds (außer den an den Sub-Investment-Manager zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Methode (Fortsetzung)

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Der Sub-Investment-Manager hat im Berichtsjahr keine erfolgsabhängigen Gebühren erhalten. Bis zum 31. Dezember 2022 hatten die vom Sub-Investment-Manager ernannten Berater („nicht verbundene Unterberater") Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr. Die von nicht verbundenen Unterberatern vereinnahmten erfolgsabhängigen Gebühren im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 werden nachstehend aufgeführt.

	31. Dezember 2022 US$
Altiq LLP	21.317.397
BH-DG Systematic Trading LLP	15.047.058
Crabel Capital Management LLC	4.457.671
P/E Global LLC	13.075.361
Portman Square Capital	12.616.619
Sandbar Asset Management LLP	121.822
Soloda Investment Advisors LLP	9.242.199

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Uncorrelated Trading*

Der Sub-Investment-Manager hat unter Umständen Anspruch auf eine erfolgsabhängige Gebühr, die aus dem Portfoliovermögen und wie genauer unten beschrieben zahlbar ist. Alle Anteilkassen im Portfolio sind PF-Klassen.

Definitionen

Benchmark	ICE BofA 1- Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index in der entsprechenden Klassenwährung. Die Benchmark ist ein weit verbreiteter Richtwert für kurzfristige Zinssätze, der einen Anhaltspunkt für die Durchschnittskurse liefert, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankenkredite aufnehmen können.
Berechnungszeitraum	Der Berechnungszeitraum geht normalerweise jährlich vom 1. Januar bis zum 31. Dezember, mit Ausnahme, dass: • im Fall der Erstausgabe von Anteilen in jeder Klasse der erste Berechnungszeitraum vom Ausgabedatum bis zum 31. Dezember des folgenden Jahres geht; • im Fall der Auflösung einer Klasse der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet; und • im Fall der Auflösung des Vertrags des Sub-Investment-Managers während eines Jahres, der Berechnungszeitraum am Datum der Auflösung endet.
Festlegung (Kristallisierung)	Der Punkt, an dem eine erfolgsabhängige Gebühr an den Sub-Investment-Manager zahlbar wird. Die Festlegung erfolgt entweder (i) am Ende des Berechnungszeitraums, (ii) bei Beendigung der Bestellung des Sub-Investment-Managers oder (iii) an einem Handelstag, an dem ein Anteilinhaber den gesamten oder einen Teil seines Anteilsbestands zurückgibt oder umtauscht.
Outperformance	Die überdurchschnittlich positive Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil über der Performance der Benchmark im Berechnungszeitraum.

Methode

Für jeden Berechnungszeitraum wird bzgl. jeder ausgegebenen Klasse eine erfolgsabhängige Gebühr für eine Outperformance fällig, d. h. die überdurchschnittlich positive Wertentwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil (nach Abzug aller Kosten vor dem Abzug einer aufgelaufenen erfolgsabhängigen Gebühr, sofern dies im besten Interesse des Anteilinhabers liegt) gegenüber der Wertentwicklung der für die jeweilige Klasse geltenden Benchmark während des Berechnungszeitraums. Die erfolgsabhängige Gebühr wird an jedem Handelstag berechnet und entspricht bis zu 20 % der für diese spezielle Klasse im selben Zeitraum geltenden Outperformance.

Für den Fall, dass die Performance einer Klasse über einen Berechnungszeitraum geringer ist als die der Benchmark, fällt in Bezug auf diese Klasse keine erfolgsabhängige Gebühr an, bis eine solche kumulative Underperformance gegenüber ihrer Benchmark hereingeholt wurde.

Im Fall, dass die Klasse eine Outperformance in einem Berechnungszeitraum erzielt hat, wird eine erfolgsabhängige Gebühr in Bezug auf diese Klasse zahlbar. Nach der Zahlung wird die Benchmark angepasst, dieser Prozess gewährleistet, dass der Nettoinventarwert je Anteil und die Benchmark zu Beginn des Berechnungszeitraums von derselben Stelle ausgehen. Folglich entspricht der anfängliche Benchmarkwert für den nächsten Berechnungszeitraum dem Nettoinventarwert in Bezug auf die Klasse, für die die erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, d. h. wenn der Nettoinventarwert am Ende eines Berechnungszeitraums, in dem eine erfolgsabhängige Gebühr gezahlt wurde, 110 betragen würde, würde der Benchmarkwert zu Beginn des folgenden Berechnungszeitraums ebenfalls 110 betragen.

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass im Falle einer zahlbaren erfolgsabhängigen Gebühr auf die Outperformance gegenüber der Benchmark ihnen auch dann eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, wenn der Nettoinventarwert je Anteil zurückgegangen ist, allerdings in einem geringeren Ausmaß als die Benchmark.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

6. GEBÜHREN DES MANAGERS, DER VERWALTUNGSSTELLE, DER VERTRIEBSSTELLE UND DER VERWAHRSTELLE (FORTSETZUNG)

Erfolgsabhängige Gebühren (Fortsetzung)

An den Manager und einen Sub-Investment-Manager gezahlte erfolgsabhängige Gebühr (Fortsetzung)

Uncorrelated Trading* (Fortsetzung)

Methode (Fortsetzung)

Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass die erfolgsabhängige Gebühr auf Anteilklassenebene und nicht auf Ebene des individuellen Anteilinhabers berechnet wird und ihnen daher unter Umständen eine erfolgsabhängige Gebühr in Rechnung gestellt wird, selbst wenn der Nettoinventarwert ihrer Anteile gleich geblieben oder zurückgegangen ist, zum Beispiel, wenn Anteilinhaber Anteile zu einem Zeitpunkt kaufen oder verkaufen, bei dem es sich nicht um den Beginn oder das Ende des Berechnungszeitraums handelt.

Die erfolgsabhängige Gebühr wird täglich zu jedem Bewertungszeitpunkt ermittelt und läuft zu diesem auf. Die erfolgsabhängige Gebühr wird auf den nicht für eine Verwässerungsgebühr angepassten Nettoinventarwert je Anteil berechnet, d. h. bevor eine Swing-Pricing-Anpassung erfolgte (weitere Informationen in Bezug auf „Swing Pricing" sind im Abschnitt „Ermittlung des Nettoinventarwerts – Bewertungsanpassungen und Swing Pricing" des Verkaufsprospekts enthalten).

Die erfolgsabhängige Gebühr wird gewöhnlich rückwirkend innerhalb von 30 Geschäftstagen nach dem 31. Dezember jeden Jahres an den Sub-Investment-Manager gezahlt. Für den Fall der Feststellung einer erfolgsabhängigen Gebühr während eines Berechnungszeitraums wird die aufgelaufene erfolgsabhängige Gebühr für solche Beträge innerhalb von 30 Geschäftstagen nach Ende des Kalenderquartals zahlbar, in dem die Feststellung erfolgte.

Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren verbleiben im Portfolio, bis sie an den Sub-Investment-Manager gezahlt werden, und partizipieren nicht an darauffolgenden Gewinnen oder Verlusten des Portfolios. Festgestellte erfolgsabhängige Gebühren werden nicht zur Bedienung von Rücknahmeanträgen oder zur Zahlung von Gebühren und Aufwendungen des Portfolios oder des Fonds (außer den an den Sub-Investment-Manager zahlbaren Gebühren) herangezogen oder zu Verfügung gestellt.

Die Verwahrstelle prüft die Berechnung der erfolgsabhängigen Gebühr und stellt sicher, dass sie nicht manipuliert werden kann.

Erfolgsabhängige Gebühren fallen auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge (zur Klarstellung: einschließlich Anlageerträgen) unter Berücksichtigung der realisierten und nicht realisierten Verluste zum Ende des Berechnungszeitraums an. Daher können erfolgsabhängige Gebühren auf nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge niemals realisiert werden.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden vom Portfolio keine erfolgsabhängigen Gebühren an den Sub-Investment-Manager gezahlt (31. Dezember 2022: 1.351 US$).

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Gebühren der Verwahrstelle
Die Gesellschaft bezahlt der Verwahrstelle eine Gebühr für Treuhanddienstleistungen für jedes Portfolio die maximal 0,02 % pro Jahr des NIW des jeweiligen Portfolios beträgt und monatlich anfällt und monatlich rückwirkend zahlbar ist. Die Verwahrstelle hat auch Anspruch auf Erstattung von dem Fonds aus dem Portfoliosvermögen von Verwahrgebühren, Transaktionsgebühren und angemessenen Auslagen („Depotbankgebühren"), die zugunsten des Portfolios entstehen, einschließlich der Gebühren (die normale kommerzielle Sätze nicht übersteigen werden) und angemessener Auslagen von Unter-Depotbanken, die von der Verwahrstelle beauftragt werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

7. HONORARE UND AUFWENDUNGEN DER DIREKTOREN

Die Direktoren haben als Vergütung für ihre Dienste Anspruch auf ein Honorar, dessen Höhe von Zeit zu Zeit von den Direktoren festgelegt wird, wobei der an einen Direktor jährlich in Bezug auf den Fonds zu zahlende Betrag der Vergütung 75.000 EUR (oder 85.000 EUR im Falle eines Vorsitzenden des Fonds) oder einen anderen Betrag, den die Direktoren jeweils ggf. festlegen, nicht überschreiten wird. Die Direktoren sowie diese ggf. vertretende Direktoren haben Anspruch auf die Erstattung sämtlicher angemessener Reise-, Hotel- und anderer Kosten, die ihnen bei der Teilnahme an Sitzungen der Direktoren oder der Anteilinhaber oder anderen Versammlungen im Zusammenhang mit dem Geschäftsbetrieb des Fonds entstehen. Sämtliche auf die Honorare der Direktoren gezahlten Lohnsteuern sind in den Gesamtkosten enthalten. Keiner der Direktoren hat einen Dienstvertrag mit dem Fonds abgeschlossen, derartige Verträge sind auch nicht vorgesehen, und kein Direktor ist in der Unternehmensleitung des Fonds tätig. Die Direktoren, die zugleich Mitarbeiter von Neuberger Berman Europe Limited sind, erhalten für ihre Dienstleistungen als Direktoren der Gesellschaft kein Honorar.

Die Gesamtbezüge der Direktoren (einschließlich Spesen) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 betrugen insgesamt 234.165 US$ (31. Dezember 2022: 259.448 US$), von denen 19.272 US$ am Jahresende noch ausstanden (31. Dezember 2022: 60.237 US$).

Zum 31. Dezember 2023 waren Michelle Green und Alex Duncan Direktoren und ebenfalls bei der Neuberger Berman Europe Limited („NBEL"), dem Sub-Investment-Manager und der Vertriebsstelle des Fonds, angestellt. Bis yum 15. Februar 2023 war Frau Michelle Green zudem eine Direktorin der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL"), dem Manager des Fonds. Frau Gráinne Alexander ist zudem Direktorin von NBAMIL. Michelle Green und Alex Duncan haben sich freiwillig bereit erklärt auf ihren Anspruch auf eine Vergütung in Hinblick auf ihre Pflichten als Direktoren für das zum 31. Dezember 2023 beendete Geschäftsjahr zu verzichten (31. Dezember 2022: ebenso).

Die Honorare der Direktoren werden vor Abzug der Einkommensteuer ausgewiesen. Von den Direktoren wurden keine Sachleistungen bezogen.

8. VERGÜTUNG DER ABSCHLUSSPRÜFER

Ernst & Young, Chartered Accountants haben für ihre im Geschäftsjahr geleistete Arbeit für den Fonds folgende Vergütung (ohne MwSt.) erhalten:

		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
Gesetzliches Prüfungshonorar:	- Ernst & Young (Irland):	481.925	482.682
Sonstige Honorare ohne Prüfungshonorare:	- Ernst & Young (Österreich):	130.939	141.982
	- Ernst & Young (Schweiz):	130.000	126.681

9. SONSTIGE GEBÜHREN UND KOSTEN

Die Transaktionskosten sind die beim Kauf, bei der Emission oder beim Verkauf von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten anfallenden Kosten. Zu den Transaktionskosten gehören Gebühren und Provisionen für Makler und Händler, die an Aufsichtsbehörden und Börsen zahlbaren Gebühren und bei der Übertragung fällig werdenden Steuern und Abgaben. Die Transaktionskosten erstrecken sich nicht auf Auf- oder Abschläge auf Fremdkapitalanlagen, Finanzierungskosten oder interne Verwaltungs- bzw. Haltekosten. Diese Kosten werden verbucht, sobald sie anfallen und für die Zwecke der Finanzberichterstattung in der Gewinn- und Verlustrechnung als Aufwand erfasst.

Der Fonds und die Portfolios zahlen auch bestimmte sonstige Kosten, Gebühren, Honorare und Aufwendungen, die im Rahmen ihres Betriebs entstehen. Diese können insbesondere Gebühren und Kosten enthalten, die im Zusammenhang mit Bank- und Maklerdienstleistungen beim Kauf und Verkauf von Wertpapieren der Portfolios entstehen, Steuern, Versicherungen, die Kosten und Aufwendungen für die Buchführung und die Abfassung, den Druck, die Veröffentlichung und Verteilung der Verkaufsprospekte, Nachträge, Jahres- und Halbjahresberichte und sonstiger Dokumente und Informationen (in den jeweils notwendigen Sprachen) für bestehende oder potenzielle Anteilinhaber (einschließlich der Kosten für die Entwicklung und Verbesserung von Software und elektronischen Übertragungstechniken zur Verteilung dieser Dokumente oder Informationen), die Kosten für die Veröffentlichung von Preis- und Renditeinformationen in den relevanten Medien, die Kosten und Aufwendungen für das Einholen von Genehmigungen oder Registrierungen der Gesellschaft oder von Anteilen bei den Aufsichtsbehörden verschiedener Rechtsordnungen, einschließlich etwaiger von der Central Bank of Ireland erhobener Abgaben, die Kosten für die Notierung und Aufrechterhaltung der Notierung von Anteilen an einer Börse, Marketing- und Werbekosten, die Kosten für die Einberufung und Abhaltung der Versammlungen der Direktoren und der Anteilinhaber , die Kosten für die Ausübung der Stimmrechte im Zusammenhang mit der Anlage der Gesellschaft im besten Interesse der Anteilinhaber und die Honorare und Aufwendungen für Rechts-, Rechnungsprüfungs- und andere Beratungsleistungen, sämtliche Kosten, die durch die Auflösung oder Liquidierung der Gesellschaft entstehen, sowie alle weiteren Kosten und Aufwendungen (einmalige und außerordentliche Kosten und Aufwendungen eingeschlossen), die von Zeit zu Zeit entstehen und von den Direktoren als notwendig oder angemessen für den fortdauernden Geschäftsbetrieb der Gesellschaft oder eines Portfolios genehmigt wurden. Im Zusammenhang mit der Registrierung des Fonds oder der Anteile zum Verkauf in bestimmten Rechtsordnungen zahlt der Fonds die Gebühren und Kosten von Zahl- und Informationsstellen und/oder Korrespondenzbanken. Diese Zahlungen erfolgen zu marktüblichen Sätzen.

Der Manager begleicht alle Kosten für von ihm bezogenes Research direkt, ungeachtet der Bezugsquelle. Sub-Investment-Manager mit Sitz außerhalb der EU, die bezogenes Research nicht in die EU weiterleiten, können dem betreffenden Portfolio durch Bereitstellung eines jährlichen Research-Budgets für jedes Portfolio Research-Kosten in Rechnung stellen. Die Abgrenzungen für Research-Kosten für Uncorrelated Strategies bzw. Uncorrelated Trading im zum 31. Dezember 2023 endenden Geschäftsjahr beliefen sich auf 4.979.140 USD bzw. 50.854 USD (31. Dezember 2022: 4.954.833 USD bzw. 223.050 USD).

Für die Zwecke des Jahresabschlusses werden Gründungsaufwendungen in der Gewinn- und Verlustrechnung als Aufwand erfasst. Für die Berechnung des NIW pro Anteil Aktie für Handelszwecke der Anteilinhaber werden Gründungsaufwendungen über die ersten zwei Jahre der Laufzeit des Portfolios abgeschrieben.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN

Gemäß FRS 102 „Transaktionen mit nahe stehenden Parteien" gelten Parteien als nahe stehend, wenn eine Partei die Möglichkeit hat, die Kontrolle über die andere Partei auszuüben oder bei finanziellen oder betrieblichen Entscheidungen entscheidenden Einfluss auf die andere Partei auszuüben.

Michelle Green und Alex Duncan sind Direktoren des Fonds und sind auch bei der NBEL, dem Sub-Investment-Manager und der Vertriebsstelle des Fonds, angestellt. Bis zum 15. Februar 2023 war Frau Michelle Green auch Direktorin von NBAMIL, der Manager der Gesellschaft. Frau Gráinne Alexander ist zudem Direktorin von NBAMIL. Die von NBEL und NBAMIL in den Jahren zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 erhältlichen Gebühren sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt. Nähere Angaben zu den in den zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 gezahlten Honoraren der Direktoren finden sich in Anmerkung 7.

Managementgebühren, Gebühren der Verwaltungsstelle und erfolgsabhängige Gebühren*	31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
Von NBAMIL erhaltene Managementgebühren und Gebühren der Verwaltungsstelle, ohne Verzichte	197.829.109	225.475.911
Beratungsgebühren	17.684.684	-
Beratungsgebühren und Kostenverzichte	(3.634.372)	(3.103.202)
Ausstehende Managementgebühren	16.054.874	18.121.204
Von NBAMIL erhaltene erfolgsabhängige Gebühren	1.553.554	89.185
Ausstehende erfolgsabhängige Gebühren	-	89.185

*Weitere Informationen zu den Managementgebühren und erfolgsabhängigen Gebühren finden sich in Anmerkung 6.

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hielten folgende Portfolios Anteile an anderen, von mit dem Manager verbundenen Unternehmen verwalteten Portfolios:

			31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
Portfolio	**Bestand***	**Verwaltet von**	**Anteile**	**Wert**	**Anteile**	**Wert**
Corporate Hybrid Bond	Global Investment Grade Credit	NBAMIL	1.300.000	10.956.412	1.300.000	10.317.170
Emerging Market Debt - Hard Currency	Ultra Short Term Euro Bond	NBAMIL	150.000	17.580.000	150.000	16.110.000
Emerging Market Debt - Local Currency	China Bond	NBAMIL	1.595.000	16.173.300	1.595.000	15.136.550
Emerging Market Debt Blend	China Bond	NBAMIL	1.409.964	14.297.035	1.409.964	13.380.558
Global Flexible Credit Income	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBAMIL	75.108	66.832	394.721	338.564
Global Opportunistic Bond	Global Investment Grade Credit	NBAMIL	-	-	200.000	1.694.000
Global Opportunistic Bond	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBAMIL	23.786	21.165	125.000	107.216
High Yield Bond	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBAMIL	4.058.488	3.611.285	21.329.208	18.294.706
Multi-Asset Income	China Bond	NBAMIL	-	-	40.890	388.047
Multi-Asset Income	Commodities	NBAMIL	-	-	16.300	184.515
Short Duration Emerging Market Debt	Ultra Short Term Euro Bond	NBAMIL	425.000	49.810.000	655.000	70.347.000
Short Duration High Yield SDG Engagement	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBAMIL	270.876	241.028	1.423.570	1.221.039
Strategic Income	China Bond	NBAMIL	1.208.113	11.936.155	1.208.113	11.815.344
Strategic Income	Euro Bond Absolute Return	NBAMIL	760.691	9.158.724	945.691	10.270.208

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

			31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
Portfolio (Fortsetzung)	**Bestand***	**Verwaltet von**	**Anteile**	**Wert**	**Anteile**	**Wert**
Strategic Income	European High Yield Bond	NBAMIL	486.855	6.382.668	486.855	5.477.118
Strategic Income	Global Flexible Credit Income	NBAMIL	459.982	5.570.377	459.982	4.921.803
Strategic Income	Global SDG Engagement	NBAMIL	654.438	8.952.716	654.438	8.062.679
Strategic Income	Global Investment Grade Credit	NBAMIL	2.000.000	18.620.000	2.000.000	16.940.000
Strategic Income	NB Global Monthly Income Fund Ltd**	NBAMIL	163.871	145.814	861.209	738.685

*Zum 31. Dezember 2023 (ggf. 31. Dezember 2022) betrug die effektive Managementgebühr nach Ermäßigung(en) für jede der oben genannten Bestände in jedem Portfolio 0,00 %.
** Die Managementgebühr für den NB Global Monthly Income Fund Ltd beträgt 0,75 %.

Der Manager gewährte den vorstehend genannten Portfolios im Zusammenhang mit ihren Anlagen einen Rabatt, so dass ihre effektiven Managementgebührensätze für die Anlagen 0,00 % betrugen (31. Dezember 2022: gleich). Der von jedem Portfolio gewährte Gebührenverzicht wird unter „Verzicht auf Beratungsgebühren" in den Gewinn- und Verlustrechnungen ausgewiesen.

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 wurden die Überkreuzinvestitionen zwischen den Portfolios der Gesellschaft vom konsolidierten Abschluss ausgeschlossen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Den Direktoren sind mit Ausnahme der in diesem Jahresabschluss angegebenen keine Transaktionen mit nahe stehenden Parteien im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 bekannt (31. Dezember 2022: ebenso).

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hatten die folgenden Anteilinhaber, die als nahe stehende Parteien galten, folgende Anlagen im Fonds getätigt.

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse AUD I2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	4.665	-
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse CHF A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.627	-
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse CHF I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.627	-
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse CHF I2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.675	-
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse CNY I2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.181	-
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	1.871
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse EUR I2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.791	-
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse EUR I5	Mitarbeiter von Neuberger Berman	1.965	1.965
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.326	2.326
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse GBP I2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.400	-
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse HKD I2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	23.473	-
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse SGD I2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.039	-
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	-	500
5G Connectivity	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	552
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse USD I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse USD I5	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.953	9.953
5G Connectivity	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	108.423	112.195
China A-Share Equity	Thesaurierende Klasse CNY I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	688	688
China A-Share Equity	Thesaurierende Klasse CNY I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	774	774
China A-Share Equity	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.000	1.000
China A-Share Equity	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Employee	1.934	1.934
China A-Share Equity	Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	250.091	250.091
China Bond	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.993	1.993
China Bond	Ausschüttende Klasse CNY I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.347	2.347

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
China Bond	Thesaurierende Klasse CNY Z	Neuberger Berman Employee	1.218	1.218
China Bond	Thesaurierende Klasse CNY Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	614	614
China Bond	Thesaurierende Klasse GBP I2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.176	2.176
China Bond	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.003	1.003
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Emerging Market Debt - Local Currency	1.595.000	1.595.000
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Emerging Market Debt Blend	1.409.964	1.409.964
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Multi-Asset Income	-	40.890
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Employee	40.000	40.000
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Employee	196	7.283
China Bond	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	Strategic Income	1.208.113	1.208.113
China Equity	Thesaurierende Klasse EUR Z	Neuberger Berman Employee	891	891
China Equity	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Employee	16.177	16.177
Climate Innovation[1]	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Climate Innovation[1]	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Climate Innovation[1]	Thesaurierende Klasse USD I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Climate Innovation[1]	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	300.000	-
CLO Income	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.824	2.824
CLO Income	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.144	3.144
CLO Income	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Employee	51.167	42.619
Commodities[2]	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	806	806
Commodities[2]	Thesaurierende Klasse GBP I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.290
Commodities[2]	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	1.431	1.431
Commodities[2]	Thesaurierende Klasse USD Z	Multi-Asset Income	-	16.300
Commodities[2]	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000
Commodities[2]	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	15.263	9.284
Corporate Hybrid Bond	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.390	1.390

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
Corporate Hybrid Bond	Thesaurierende Klasse EUR I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	15.690	9.000
Corporate Hybrid Bond	Ausschüttende Klasse EUR I2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.462
Corporate Hybrid Bond	Thesaurierende Klasse GBP I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	973	973
Corporate Hybrid Bond	Ausschüttende Klasse USD A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	3.000
Corporate Hybrid Bond	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	3.000
Corporate Hybrid Bond	Ausschüttende Klasse USD I2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.128	1.128
Corporate Hybrid Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	33.729	33.729
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse CHF I2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.911	2.911
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse CHF P	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.118	1.118
Emerging Market Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.008
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse EUR I4	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.644	-
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse EUR P	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	946
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	59.506	36.062
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse GBP P	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	978
Emerging Market Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Emerging Market Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD I2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Emerging Market Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.752	9.752
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse AUD B	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	824	824
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse AUD C2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	925	-
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse AUD E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.494	1.494
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse AUD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.472	1.472
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse EUR I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	14.328	14.328
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse GBP I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	25.991	7.903
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse GBP I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.011	1.011
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse SEK A	Mitarbeiter von Neuberger Berman	11.535	11.535

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse USD B	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse USD E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Emerging Market Debt - Local Currency	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust	4.340.412	5.097.097
Emerging Market Debt - Local Currency	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Global Strategic Income	192.560	192.560
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse USD I5	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.579	-
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse USD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	950	950
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse ZAR C2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.596	-
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse ZAR E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	855	855
Emerging Market Debt - Local Currency	Thesaurierende Klasse ZAR T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.683	1.683
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse EUR I3	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.000	3.000
Emerging Market Debt Blend	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	13.085	9.487
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse GBP I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	746
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	746	746
Emerging Market Debt Blend	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	772	772
Emerging Market Debt Blend	Thesaurierende Klasse NOK U	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.286	2.286
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	699	699
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.025	1.025
Emerging Market Debt Blend	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	9	9
Emerging Market Debt Blend	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.460	9.460
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Thesaurierende Klasse NOK I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	808	808
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Thesaurierende Klasse NOK I3	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.219	-
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	81	81
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	155.674	250.358

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse AUD B	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.356	1.356
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse AUD C2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.575	-
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse AUD E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.356	1.356
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse AUD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.662	2.662
Emerging Markets Equity	Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	8.283	8.283
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	901	901
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	22.279	22.279
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse GBP Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	800	800
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse USD C2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	967	-
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse USD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	670	670
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	22.606	24.884
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse ZAR B	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.410	1.410
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse ZAR E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.410	1.410
Emerging Markets Equity	Thesaurierende Klasse ZAR T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.765	2.765
Emerging Markets Select Equity	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	814
Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.000	3.000
Euro Bond	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	978.926	978.926
Euro Bond Absolute Return	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	28.155	28.155
Euro Bond Absolute Return	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	930	930
Euro Bond Absolute Return	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	247.390	247.390
Euro Bond Absolute Return	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.146.064	1.146.064
Euro Bond Absolute Return	Thesaurierende Klasse USD Z	Strategic Income	760.691	945.691
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.947	1.947
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse EUR X	Mitarbeiter von Neuberger Berman	13.224	4.413
European High Yield Bond	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.630

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.639	3.639
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	472.326
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	386	386
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	827.807
European High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Strategic Income	486.855	486.855
European Sustainable Equity	Ausschüttende Klasse EUR A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.627	2.627
European Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	825	825
European Sustainable Equity	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.027	1.027
European Sustainable Equity	Ausschüttende Klasse EUR I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.593	2.593
European Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.649	1.649
European Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse EUR Z	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	408.530	408.530
European Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	31.579	32.029
European Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse EUR Z	Neuberger Berman Group LLC	4.772.441	3.124.536
European Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
European Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
European Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Group LLC	-	1.970.793
European Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Event Driven[2]	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	922	-
Event Driven[2]	Ausschüttende Klasse GBP I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.584	2.584
Event Driven[2]	Thesaurierende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.584	2.584
Event Driven[2]	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	-	1.000.000
Event Driven[2]	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Global Bond	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.937	3.937
Global Bond	Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.766	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
Global Bond	Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	3.000
Global Bond	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	888	888
Global Bond	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.000	3.000
Global Bond	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	4.481	4.481
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.009
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	786	-
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse SGD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.010	-
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse USD C1	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	12.401	8.678
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Global Equity Megatrends	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Global Flexible Credit Income	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.359	2.359
Global Flexible Credit Income	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	3.000
Global Flexible Credit Income	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	7.763	7.763
Global Flexible Credit Income	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	32.935	22.231
Global Flexible Credit Income	Thesaurierende Klasse USD Z	Strategic Income	459.982	459.982
Global SDG Engagement	Ausschüttende Klasse AUD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	4.223	4.223
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse CHF I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.931	2.931
Global SDG Engagement	Ausschüttende Klasse CHF I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.931	2.931
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse CHF X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.931	2.931
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse EUR I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.846	2.846
Global SDG Engagement	Ausschüttende Klasse EUR I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.846	2.846
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse EUR X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.846	2.846

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)	Mitarbeiter von Neuberger Berman	13.678	-
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.539	2.539
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse GBP I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.398	2.398
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse GBP X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.398	2.398
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.796	1.796
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	816	816
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Global SDG Engagement	Ausschüttende Klasse USD M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.208	1.208
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.013	1.013
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	2.226	2.226
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	789	789
Global SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Strategic Income	654.438	654.438
Global High Yield Sustainable Action	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Global High Yield Sustainable Action	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.458.132
Global High Yield Sustainable Action	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000
Global Investment Grade Credit	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.730	-
Global Investment Grade Credit	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Global Investment Grade Credit	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Global Investment Grade Credit	Thesaurierende Klasse USD Z	Corporate Hybrid Bond	1.300.000	1.300.000
Global Investment Grade Credit	Thesaurierende Klasse USD Z	Global Opportunistic Bond	-	200.000
Global Investment Grade Credit	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	535	-
Global Investment Grade Credit	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.498.000	1.498.000
Global Investment Grade Credit	Thesaurierende Klasse USD Z	Strategic Income	2.000.000	2.000.000

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
Global Opportunistic Bond	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.530	-
Global Opportunistic Bond	Thesaurierende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.295	2.295
Global Opportunistic Bond	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.175	1.175
Global Opportunistic Bond	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	669	669
Global Opportunistic Bond	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.083	1.083
Global Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Global Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	Mitarbeiter von Neuberger Berman	18.144	9.210
Global Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse GBP Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	500	500
Global Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse USD I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.315	3.315
Global Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.811	9.811
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.649	1.649
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	Mitarbeiter von Neuberger Berman	120.430	122.222
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	722
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	722	722
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	1.000
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	9.518	9.518
Global Sustainable Equity	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.131	1.131
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	1.000
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	528.063	528.063
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	160	160
Global Sustainable Equity	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Group LLC	2.481.151	2.481.151
Global Sustainable Value	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	927	927
Global Sustainable Value	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	823	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
Global Sustainable Value	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	886
Global Sustainable Value	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	-	613
Global Sustainable Value	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	3.166	3.166
High Yield Bond	Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.675	1.675
High Yield Bond	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	15.211	15.211
High Yield Bond	Thesaurierende Klasse GBP Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	2.729	6.162
High Yield Bond	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Bond-Plus Income & Growth Multi-Asset Class Securities Investment Trust	3.907.647	5.674.132
High Yield Bond	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Global Strategic Income	259.531	483.669
High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD P	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.208	1.208
High Yield Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	7.741	28.793
High Yield Bond	Thesaurierende Klasse ZAR T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.308	1.308
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse CHF I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.747	2.747
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.539	2.539
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse EUR I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.539	2.539
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.584	2.584
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse EUR X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.539	2.539
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse SGD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.031	2.031
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse SGD I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.031	2.031
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse SGD X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.031	2.031
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	476.000	476.000
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse USD I4	Mitarbeiter von Neuberger Berman	2.037	2.037
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse USD I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
InnovAsia 5G	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Japan Equity Engagement	Ausschüttende Klasse EUR I5	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.662	-
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	787	-
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.242	2.242
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse JPY I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	3.000
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse JPY I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	3.576	3.576
Japan Equity Engagement	Ausschüttende Klasse JPY I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	497.000
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse JPY I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	318
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse JPY Z	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	778.814	-
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse JPY Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	147.815	140.482
Japan Equity Engagement	Thesaurierende Klasse JPY Z	Neuberger Berman Group LLC	2.005.146	4.692.912
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.000	1.000
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse EUR I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	-	23.771
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse GBP Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	2.005	16.762
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse SEK I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.830	2.830
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	1.081	1.081
Macro Opportunities FX	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	7.959	7.959
Multi-Asset Income	Ausschüttende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.332
Multi-Asset Income	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	-	847
Multi-Asset Income	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	-	2.917
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.000	1.000
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.459	2.459
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	2.632
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse USD C1	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	10	1.000
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	-	3.000

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	738	738
Next Generation Mobility	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	730	730
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	3.000	3.000
Next Generation Mobility	Thesaurierende Klasse USD X	Mitarbeiter von Neuberger Berman	588	588
Next Generation Space Economy[2]	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	94.928	94.928
Next Generation Space Economy[2]	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	94.928	94.928
Next Generation Space Economy[2]	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	300.000	300.000
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.046	1.046
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.162.791
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD I4	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD X	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.193	2.193
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	3.887.269	-
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.004.281	-
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Group LLC	848.201	848.201
Short Duration Emerging Market Debt	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.365	1.365
Short Duration Emerging Market Debt	Ausschüttende Klasse GBP I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	814
Short Duration Emerging Market Debt	Thesaurierende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.487
Short Duration Emerging Market Debt	Thesaurierende Klasse SEK A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.374	2.374
Short Duration Emerging Market Debt	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	31.591	28.808

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
Short Duration High Yield SDG Engagement	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	23.546	23.546
Short Duration High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD I4	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Short Duration High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Asia Holdings LLC	7.984	-
Short Duration High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Cayman Asia Holdings Ltd	2.654	-
Short Duration High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	876	839
Short Duration High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	40.341	32.263
Short Duration High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	3.422	6.782
Short Duration High Yield SDG Engagement	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Group LLC	5.823	-
Strategic Income	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.137	-
Strategic Income	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.861	2.861
Strategic Income	Thesaurierende Klasse EUR I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	83.400	7.239
Strategic Income	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	834
Strategic Income	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	11.473	11.473
Strategic Income	Ausschüttende Klasse JPY I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	5.300	-
Strategic Income	Thesaurierende Klasse SGD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	682	682
Strategic Income	Ausschüttende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.093
Strategic Income	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	20.836	24.029
Sustainable Asia High Yield	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Neuberger Berman Group LLC	1.000	1.000
Sustainable Asia High Yield	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Group LLC	1.000	1.000
Sustainable Asia High Yield	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.225	1.225
Sustainable Asia High Yield	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	11.395	13.395
Sustainable Asia High Yield	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Group LLC	2.395.262	2.395.262
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Thesaurierende Klasse GBP I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	787	787
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Thesaurierende Klasse SEK A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.409	2.409
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.040

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
Tactical Macro[1]	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Tactical Macro[1]	Thesaurierende Klasse USD I5	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
Tactical Macro[1]	Thesaurierende Klasse USD Z	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	500.000	-
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse CHF U	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	294	294
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	247
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	122
Ultra Short Term Euro Bond	Ausschüttende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	119	119
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	252	252
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR U	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	79	79
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	19.030	22.356
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Emerging Market Debt - Hard Currency	150.000	150.000
Ultra Short Term Euro Bond	Thesaurierende Klasse USD Z	Short Duration Emerging Market Debt	425.000	655.000
Uncorrelated Strategies	Thesaurierende Klasse EUR P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.931	2.931
Uncorrelated Strategies	Ausschüttende Klasse GBP I2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	858	858
Uncorrelated Strategies	Thesaurierende Klasse GBP Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	21.992	21.992
Uncorrelated Strategies	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	24.926	16.007
US Equity	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	415	415
US Equity	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	997
US Equity	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	229.104	229.104
US Equity	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.132	2.132
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse EUR I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.655	2.655
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse EUR I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.111	1.111
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse EUR I4	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	2.748	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse EUR M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.143	1.143
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	941
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse GBP I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.120
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	785	-
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.187
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	809	809
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	890	-
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	-	759
US Equity Index PutWrite	Ausschüttende Klasse USD I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.134
US Equity Index PutWrite	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	102.917	117.446
US Large Cap Value	Thesaurierende Klasse EUR A	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	3.066	3.066
US Large Cap Value	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Group LLC	947	947
US Large Cap Value	Thesaurierende Klasse EUR I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.688
US Large Cap Value	Thesaurierende Klasse GBP I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.528	2.528
US Large Cap Value	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	843	843
US Large Cap Value	Ausschüttende Klasse GBP I	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.528	2.528
US Large Cap Value	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	843	843
US Large Cap Value	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Group LLC	797	797
US Large Cap Value	Ausschüttende Klasse GBP P	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.678	2.678
US Large Cap Value	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Group LLC	-	797
US Large Cap Value	Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	858	858
US Large Cap Value	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	-	8.044
US Large Cap Value	Thesaurierende Klasse USD I	Neuberger Berman Group LLC	-	4.524
US Large Cap Value	Thesaurierende Klasse USD Y	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
US Large Cap Value	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	20.291	1.016
US Long Short Equity	Thesaurierende Klasse EUR I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	-	2.771
US Long Short Equity	Ausschüttende Klasse GBP I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.302	2.302
US Long Short Equity	Thesaurierende Klasse USD I3	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	1.000
US Long Short Equity	Thesaurierende Klasse USD M	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.115	1.115
US Long Short Equity	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	13.313	13.363
US Multi Cap Opportunities	Thesaurierende Klasse AUD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	516	516
US Multi Cap Opportunities	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.065	1.065
US Multi Cap Opportunities	Thesaurierende Klasse USD I2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.000	-
US Multi Cap Opportunities	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	12.011	12.942
US Multi Cap Opportunities	Ausschüttende Klasse USD1 I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	268	268
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.418	1.418
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.586	1.586
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.424	1.424
US Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse AUD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.140	1.140
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	943	943
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse USD I	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.008
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	985	985
US Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	15.120	15.008
US Real Estate Securities	Thesaurierende Klasse ZAR C2	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	1.776	2.921
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.790	1.790
US Real Estate Securities	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.208	1.208
US Small Cap	Thesaurierende Klasse AUD B	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	727	727
US Small Cap	Thesaurierende Klasse AUD C2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.010	1.010

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

10. TRANSAKTIONEN MIT NAHE STEHENDEN PARTEIEN (FORTSETZUNG)

Portfolio	Anteilklasse	Anteilinhaber	31. Dezember 2023 Anzahl der Anteile	31. Dezember 2022 Anzahl der Anteile
US Small Cap	Thesaurierende Klasse AUD E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	756	756
US Small Cap	Thesaurierende Klasse AUD T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.329	1.329
US Small Cap	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	Neuberger Berman Cayman Holdings Ltd	2.531	2.531
US Small Cap	Thesaurierende Klasse EUR Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	19.268	18.894
US Small Cap	Thesaurierende Klasse USD C2	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	153	-
US Small Cap	Thesaurierende Klasse USD Z	Mitarbeiter von Neuberger Berman	8.635	10.663
US Small Cap	Thesaurierende Klasse ZAR E	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	745	745
US Small Cap	Thesaurierende Klasse ZAR T	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	1.812	1.812
US Small Cap Intrinsic Value	Thesaurierende Klasse USD A	Neuberger Berman Europe Holdings LLC	-	1.000
US Small Cap Intrinsic Value	Thesaurierende Klasse USD I	Mitarbeiter von Neuberger Berman	958	958

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN

Beizulegender Zeitwert von Anlagen

	5G Connectivity		Absolute Return Multi Strategy*	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(90.236.077)	(480.089.945)	(18.814)	(3.129)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(15.038.937)	(53.103.108)	(145)	(4.362)
	(105.275.014)	(533.193.053)	(18.959)	(7.491)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	437.989.861	(412.983.630)	(452)	(13.114)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	9.973.331	4.336.986	19	20
	447.963.192	(408.646.644)	(433)	(13.094)
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	342.688.178	(941.839.697)	(19.392)	(20.585)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

* Der Absolute Return Multi Strategy wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	China A-Share Equity		China Bond	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	CNY	CNY	CNY	CNY
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(4.404.478)	(2.051.051)	3.576.296	(47.859.261)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	108.671	131.494	465.916	6.533.634
	(4.295.807)	(1.919.557)	4.042.212	(41.325.627)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	2.301.488	(3.907.067)	16.943.620	19.316.084
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(83.806)	115.492	3.901.574	(878.279)
	2.217.682	(3.791.575)	20.845.194	18.437.805
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	(2.078.125)	(5.711.132)	24.887.406	(22.887.822)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	China Equity		Climate Innovation[1]
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023
	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(60.500.162)	(30.904.361)	(170.258)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(8.498.656)	(5.247.061)	(3.990)
	(68.998.818)	(36.151.422)	(174.248)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	1.062.218	(70.415.570)	75.353
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	2.551.593	(12.256.852)	15.562
	3.613.811	(82.672.422)	90.915
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	(65.385.007)	(118.823.844)	(83.333)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	CLO Income		Commodities[2]	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(602.334)	(9.982.934)	(10.452.143)	(3.361.701)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(110.614)	91.107	(13.702)	536
	(712.948)	(9.891.827)	(10.465.845)	(3.361.165)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	14.494.255	(16.598.419)	1.021.047	1.346.623
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	1.515.407	(559.978)	(151)	1
	16.009.662	(17.158.397)	1.020.896	1.346.624
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	15.296.714	(27.050.224)	(9.444.949)	(2.014.541)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Corporate Hybrid Bond		Developed Market FMP – 2027[1]	Emerging Market Debt - Hard Currency	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	EUR	EUR	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen					
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(152.927.709)	(102.874.764)	(21.479)	(158.287.937)	(264.197.117)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	4.348.385	33.878.891	(542)	(3.381.435)	(13.182.862)
	(148.579.324)	(68.995.873)	(22.021)	(161.669.372)	(277.379.979)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	229.282.682	(266.900.364)	3.780.658	348.695.906	(608.219.340)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(4.304.724)	(26.066.929)	(35)	24.401.986	(21.966.897)
	224.977.958	(292.967.293)	3.780.623	373.097.892	(630.186.237)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	76.398.634	(361.963.166)	3.758.602	211.428.520	(907.566.216)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Emerging Market Debt - Local Currency		Emerging Market Debt Blend	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(44.584.131)	(242.882.245)	(21.580.799)	(124.176.650)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(48.092.632)	(72.390.918)	(4.256.866)	(19.792.555)
	(92.676.763)	(315.273.163)	(25.837.665)	(143.969.205)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	110.241.381	(31.142.315)	50.206.109	(47.239.064)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	80.456.531	(15.633.154)	12.011.863	(3.085.882)
	190.697.912	(46.775.469)	62.217.972	(50.324.946)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	98.021.149	(362.048.632)	36.380.307	(194.294.151)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend		Emerging Markets Equity	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(5.791.115)	(3.582.513)	(20.729.912)	(35.683.852)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(198.927)	(727.107)	(9.655.337)	(12.336.247)
	(5.990.042)	(4.309.620)	(30.385.249)	(48.020.099)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	5.676.743	(5.437.577)	31.028.370	(50.571.556)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	1.563.693	(542.245)	9.356.867	(5.958.508)
	7.240.436	(5.979.822)	40.385.237	(56.530.064)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.250.394	(10.289.442)	9.999.988	(104.550.163)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Emerging Markets Select Equity*		Euro Bond	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	EUR	EUR
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	814.528	(8.758.509)	(341.755)	(694.978)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(4.139.010)	(1.851.322)	(38)	34
	(3.324.482)	(10.609.831)	(341.793)	(694.944)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	2.969.544	(18.041.369)	1.045.890	(1.278.924)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	3.013.801	(2.488.298)	(191)	514
	5.983.345	(20.529.667)	1.045.699	(1.278.410)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2.658.863	(31.139.498)	703.906	(1.973.354)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

* Der Emerging Markets Select Equity wurde am 7. September 2023 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Euro Bond Absolute Return		European High Yield Bond	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	EUR	EUR	EUR	EUR
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(537.540)	1.175.597	(2.829.393)	3.427.555
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	32.645	80.644	(37.181)	65.204
	(504.895)	1.256.241	(2.866.574)	3.492.759
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	2.177.741	(3.934.536)	19.988.179	(5.455.410)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	33.333	(10.940)	136.601	(363.029)
	2.211.074	(3.945.476)	20.124.780	(5.818.439)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.706.179	(2.689.235)	17.258.206	(2.325.680)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	European Sustainable Equity		Event Driven[2]	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	EUR	EUR	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(13.057.162)	(11.018.173)	4.556.622	415.203
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(216.771)	478.642	(1.737)	(7.193)
	(13.273.933)	(10.539.531)	4.554.885	408.010
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	41.047.636	(22.422.863)	5.050.324	1.100.016
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	2.003.562	(1.713.109)	22	(16)
	43.051.198	(24.135.972)	5.050.346	1.100.000
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	29.777.265	(34.675.503)	9.605.231	1.508.010

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global Bond		Global Diversified Income FMP – 2024	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(8.533.831)	(11.391.342)	(673.325)	(10.699.366)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(1.255.928)	(5.336.500)	(734)	(895)
	(9.789.759)	(16.727.842)	(674.059)	(10.700.261)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	10.407.766	(11.585.556)	4.129.633	(7.559.634)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	2.216.541	(1.484.440)	(1)	–
	12.624.307	(13.069.996)	4.129.632	(7.559.634)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2.834.548	(29.797.838)	3.455.573	(18.259.895)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global Equity Megatrends		Global Flexible Credit Income	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	4.899.408	525.013	(1.617.442)	(105.497.228)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(32.081)	(11.161)	(1.344.080)	(7.159.541)
	4.867.327	513.852	(2.961.522)	(112.656.769)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	14.946.198	(11.547.989)	33.775.896	(40.182.418)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	472.026	(722.336)	4.829.687	(1.097.382)
	15.418.224	(12.270.325)	38.605.583	(41.279.800)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	20.285.551	(11.756.473)	35.644.061	(153.936.569)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global SDG Engagement		Global High Yield Sustainable Action*	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(6.863.220)	(19.998.727)	(2.101.169)	(96.461)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	1.189.384	(2.367.879)	(135.475)	(152.483)
	(5.673.836)	(22.366.606)	(2.236.644)	(248.944)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	29.380.435	(6.198.721)	2.276.456	(2.277.299)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	2.518.689	301.894	261.475	(159.626)
	31.899.124	(5.896.827)	2.537.931	(2.436.925)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	26.225.288	(28.263.433)	301.287	(2.685.869)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global Investment Grade Credit		Global Opportunistic Bond	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(8.106.722)	(602.080)	(8.077.899)	1.397.209
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(493.689)	(2.251.738)	(717.866)	(2.680.598)
	(8.600.411)	(2.853.818)	(8.795.765)	(1.283.389)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	11.728.916	(13.729.300)	8.023.365	(11.185.547)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	1.480.461	(177.244)	2.587.374	(1.515.056)
	13.209.377	(13.906.544)	10.610.739	(12.700.603)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4.608.966	(16.760.362)	1.814.974	(13.983.992)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global Real Estate Securities		Global Sustainable Equity	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(5.663.439)	(4.205.633)	(6.450.382)	(33.189.400)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(796.662)	(1.518.559)	(697.687)	(5.755.843)
	(6.460.101)	(5.724.192)	(7.148.069)	(38.945.243)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	6.035.750	(10.322.033)	35.469.091	(27.981.018)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	729.660	(317.326)	2.465.642	(1.086.634)
	6.765.410	(10.639.359)	37.934.733	(29.067.652)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	305.309	(16.363.551)	30.786.664	(68.012.895)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Global Sustainable Value		High Yield Bond	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	768.987	(1.880.826)	(162.753.558)	(222.037.281)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(281.087)	(1.207.717)	(4.742.596)	(2.727.987)
	487.900	(3.088.543)	(167.496.154)	(224.765.268)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	5.771.035	(2.242.740)	269.412.476	(274.505.380)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	604.492	(68.617)	6.186.033	(1.339.152)
	6.375.527	(2.311.357)	275.598.509	(275.844.532)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	6.863.427	(5.399.900)	108.102.355	(500.609.800)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	InnovAsia 5G		Japan Equity Engagement	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	JPY	JPY
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	2.460.434	(6.633.872)	1.662.662.886	(654.071.596)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(473.540)	(2.189.049)	2.045.222	(259.996)
	1.986.894	(8.822.921)	1.664.708.108	(654.331.592)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	3.222.419	(3.201.743)	3.022.617.990	(1.085.772.594)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	109.786	56.079	909.739	(974.538)
	3.332.205	(3.145.664)	3.023.527.729	(1.086.747.132)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	5.319.099	(11.968.585)	4.688.235.837	(1.741.078.724)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Macro Opportunities FX		Multi-Asset Income*	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	EUR	EUR	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(1.665.613)	(2.168.497)	(1.243.160)	(150.944)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(6.824)	11.958	(17.230)	(506.021)
	(1.672.437)	(2.156.539)	(1.260.390)	(656.965)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	938.724	184.774	1.261.196	(2.421.627)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(629)	(22)	121.256	(33.291)
	938.095	184.752	1.382.452	(2.454.918)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	(734.342)	(1.971.787)	122.062	(3.111.883)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Next Generation Mobility		Next Generation Space Economy[2]	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	3.899.437	(549.130)	444.429	(131.045)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(214.899)	(499.058)	(7.147)	(16.020)
	3.684.538	(1.048.188)	437.282	(147.065)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	37.448.812	(55.382.736)	2.752.444	(361.079)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	293.795	(1.386.423)	96.177	75.769
	37.742.607	(56.769.159)	2.848.621	(285.310)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	41.427.145	(57.817.347)	3.285.903	(432.375)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Responsible Asian Debt - Hard Currency		Short Duration Emerging Market Debt	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(1.467.912)	(550.962)	(159.534.063)	(702.327.934)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(48.888)	(14)	444.634	(6.224.469)
	(1.516.800)	(550.976)	(159.089.429)	(708.552.403)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	2.387.666	(1.370.732)	311.280.105	(384.394.924)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	48.869	30.608	13.548.869	(8.121.043)
	2.436.535	(1.340.124)	324.828.974	(392.515.967)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	919.735	(1.891.100)	165.739.545	(1.101.068.370)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Short Duration High Yield SDG Engagement		Strategic Income	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(27.392.333)	(79.906.575)	(57.265.475)	(80.836.421)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(510.093)	(374.053)	(2.600.408)	(5.386.191)
	(27.902.426)	(80.280.628)	(59.865.883)	(86.222.612)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	38.039.009	(9.473.114)	114.117.019	(159.562.278)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	742.261	(11.794)	6.891.526	524.902
	38.781.270	(9.484.908)	121.008.545	(159.037.376)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	10.878.844	(89.765.536)	61.142.662	(245.259.988)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Sustainable Asia High Yield		Sustainable Emerging Market Corporate Debt	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(2.256.424)	(16.823.821)	(3.653.040)	(17.600.215)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(296)	31.808	(66.913)	(91.884)
	(2.256.720)	(16.792.013)	(3.719.953)	(17.692.099)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	1.626.567	(1.727.278)	8.342.056	(11.214.596)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(71)	97	132.111	27.411
	1.626.496	(1.727.181)	8.474.167	(11.187.185)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	(630.224)	(18.519.194)	4.754.214	(28.879.284)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]		Tactical Macro[1]
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023
	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen			
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(27.069.296)	(9.025.413)	491.415
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(326.864)	(406.646)	(17.348)
	(27.396.160)	(9.432.059)	474.067
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	50.768.827	(12.332.378)	136.401
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	2.287.533	55.337	(2.219)
	53.056.360	(12.277.041)	134.182
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	25.660.200	(21.709.100)	608.249

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Ultra Short Term Euro Bond		Uncorrelated Strategies	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	EUR	EUR	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(20.393.493)	(1.942.400)	24.004.335	(176.067.661)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(2.536)	140.647	(2.592.765)	(77.274.408)
	(20.396.029)	(1.801.753)	21.411.570	(253.342.069)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	58.327.536	(76.204.998)	(132.790.013)	258.005.909
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(478)	(139.352)	(9.003.026)	73.007.817
	58.327.058	(76.344.350)	(141.793.039)	331.013.726
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	37.931.029	(78.146.103)	(120.381.469)	77.671.657

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	Uncorrelated Trading*		US Equity	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	38.237.119	(48.728.968)	(1.250.349)	(2.458.372)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	5.955.369	(3.955.039)	(795)	(10.548)
	44.192.488	(52.684.007)	(1.251.144)	(2.468.920)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	(59.155.154)	59.155.154	10.370.420	(2.885.247)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	2.274.940	(2.300.520)	3.038	–
	(56.880.214)	56.854.634	10.373.458	(2.885.247)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	(12.687.726)	4.170.627	9.122.314	(5.354.167)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst. Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) entstanden ausschließlich aus eingestellter Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	US Equity Index PutWrite		US Large Cap Value	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	89.267.388	(94.218.578)	(24.835.964)	(76.150.017)
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(109.858)	(78.841)	(177.799)	(883.489)
	89.157.530	(94.297.419)	(25.013.763)	(77.033.506)
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	18.479.312	6.625.073	(46.789.502)	49.637.130
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(315)	144	(1.747)	1.102
	18.478.997	6.625.217	(46.791.249)	49.638.232
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	107.636.527	(87.672.202)	(71.805.012)	(27.395.274)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	US Long Short Equity		US Multi Cap Opportunities	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	4.533.923	21.917.080	39.332.501	44.244.243
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(8.186)	(32.867)	(702)	1.515
	4.525.737	21.884.213	39.331.799	44.245.758
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	22.537.173	(58.748.168)	30.693.036	(194.265.895)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	38.528	18.987	108	468
	22.575.701	(58.729.181)	30.693.144	(194.265.427)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	27.101.438	(36.844.968)	70.024.943	(150.019.669)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	US Real Estate Securities		US Small Cap	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	(63.830.929)	10.997.795	(8.421.635)	44.417.166
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(2.165)	(22.220)	(26.746)	(94.020)
	(63.833.094)	10.975.575	(8.448.381)	44.323.146
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	104.804.373	(312.649.923)	94.608.303	(199.642.072)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	(52)	952	1.970	(56.422)
	104.804.321	(312.648.971)	94.610.273	(199.698.494)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	40.971.227	(301.673.396)	86.161.892	(155.375.348)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

11. NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN (FORTSETZUNG)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

	US Small Cap Intrinsic Value	
	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
	US$	US$
Realisierte und nicht realisierte Gewinne/(Verluste) aus Anlagen		
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	7.330.787	3.124.694
Realisierter Nettowährungsgewinn/(-verlust)	(3.585)	(2.359)
	7.327.202	3.122.335
Veränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes) aus Anlagen	26.969.758	(42.314.194)
Veränderung des nicht realisierten Währungsgewinnes/(-verlustes)	170	218
	26.969.928	(42.313.976)
Nettogewinn/(-verlust) aus finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	34.297.130	(39.191.641)

Die verbuchten Gesamtgewinne/(-verluste) ergaben sich ausschließlich aus der laufenden Geschäftstätigkeit.

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN

In Verfolgung seiner Anlageziele investiert der Fonds mit dem Ziel der Risikostreuung in übertragbare Wertpapiere. Durch die Anlage in Aktien und festverzinslichen Wertpapieren ergeben sich verschiedene Risiken für den Fonds, u. a. Markt-, Liquiditäts- und Kredit-/Gegenparteirisiken. Eine Darstellung der verschiedenen Risiken und der Strategien des Risikomanagements wird weiter unten gegeben. Zudem können die Folgen politischer, sozialer, wirtschaftlicher und diplomatischer Veränderungen oder der Zustand des Gesundheitswesens eine störende Wirkung auf die Marktpreise oder fairen Bewertungen von ausländischen Anlagen haben. Der beizulegende Zeitwert wird nach der in der Beschreibung der wesentlichen Bilanzierungsgrundsätze umrissenen Methode ermittelt. Die Aufstellungen des Wertpapierbestands der Portfolios zum Ende des Geschäftsjahres sind repräsentativ für die im Geschäftsjahr gehaltenen Anlageformen.

Marktrisiko

Das Marktrisiko verkörpert das Potenzial für sowohl Verluste als auch Gewinne und beinhaltet das Preisrisiko, das Zinsrisiko und das Fremdwährungsrisiko.

Alle Wertpapieranlagen unterliegen dem Risiko eines Kapitalverlustes. Der Manager und der Sub-Investment-Manager mindern dieses Risiko durch eine sorgfältige Auswahl der Wertpapiere und sonstigen Finanzinstrumente innerhalb vorgegebener Grenzen. Die gesamten Marktpositionen des Fonds werden vom Manager des Portfolios auf täglicher Basis überwacht und vierteljährlich von den Direktoren überprüft. Die Dividendenpapiere und Schuldtitel und zu Handelszwecken gehaltenen derivativen Finanzinstrumente des Fonds unterliegen einem Marktpreisänderungsrisiko, das sich aus der Ungewissheit hinsichtlich der künftigen Kursentwicklung der Instrumente ergibt.

(a) Preisänderungsrisiko

Das Preisänderungsrisiko ist das Risiko, dass die beizulegenden Zeitwerte von Wertpapieren infolge von Änderungen in den Indexständen und den Werten einzelner Wertpapiere fallen. Das Risikoexposure in Bezug auf den Handelspreis entsteht durch die Anlageportfolios des Fonds.

Der Großteil der Anlagen des Fonds ist gemäß Angabe im Verkaufsprospekt an anerkannten Börsen notiert oder wird an regulierten Märkten gehandelt. Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hätte ein 10%iger Anstieg der Wertpapierkurse einen Anstieg des Nettovermögens und der Veränderungen des Nettovermögens eines jeden Portfolios wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt zur Folge gehabt. Eine entgegengesetzte Änderung in gleicher Höhe hätte zu einer Abnahme des Nettovermögens in gleicher Höhe geführt.

Portfolio	Währung	31. Dezember 2023	% des Nettover-mögens	31. Dezember 2022	% des Nettover-mögens
5G Connectivity	USD	99.582.421	9,54 %	96.175.643	9,69 %
Absolute Return Multi Strategy*	USD	631	0,00 %	677	0,00 %
China A-Share Equity	CNY	1.348.094	9,48 %	1.531.769	9,43 %
China Bond	CNY	44.475.518	9,69 %	42.634.573	9,41 %
China Equity	USD	17.204.023	9,65 %	30.713.184	9,68 %
Climate Innovation[1]	USD	283.140	9,69 %	–	–
CLO Income	USD	17.672.631	9,52 %	11.481.421	8,32 %
Commodities[2]	USD	12.233.622	7,96 %	7.739.442	9,00 %
Corporate Hybrid Bond	EUR	175.890.908	9,41 %	162.716.118	9,13 %
Developed Market FMP – 2027[1]	USD	13.581.666	9,88 %	–	–
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	257.273.790	9,71 %	233.467.771	9,37 %
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	121.669.557	9,46 %	130.283.522	9,40 %
Emerging Market Debt Blend	USD	49.557.893	9,41 %	44.932.225	9,56 %
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	6.082.402	9,35 %	5.035.590	9,28 %
Emerging Markets Equity	USD	8.826.906	9,73 %	18.912.096	9,86 %
Emerging Markets Select Equity**	USD	–	–	9.042.698	9,64 %
Euro Bond	EUR	1.013.836	9,59 %	847.795	9,12 %
Euro Bond Absolute Return	EUR	3.177.057	9,34 %	4.624.076	9,53 %
European High Yield Bond	EUR	38.635.380	9,46 %	3.062.817	9,44 %
European Sustainable Equity	EUR	17.122.579	9,95 %	17.438.883	9,92 %
Event Driven[2]	USD	11.990.183	9,48 %	3.474.117	8,38 %
Global Bond	USD	10.728.468	9,87 %	13.167.283	9,77 %
Global Diversified Income FMP – 2024	USD	14.423.960	9,23 %	15.479.144	9,65 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Portfolio	Währung	31. Dezember 2023	% des Nettover-mögens	31. Dezember 2022	% des Nettover-mögens
Global Equity Megatrends	USD	14.149.305	9,79 %	7.946.534	10,02 %
Global Flexible Credit Income	USD	35.947.816	9,20 %	37.314.259	9,46 %
Global SDG Engagement	USD	53.770.185	9,63 %	27.747.950	8,23 %
Global High Yield Sustainable Action***	USD	–	–	1.418.914	9,43 %
Global Investment Grade Credit	USD	8.235.244	9,49 %	8.189.868	9,53 %
Global Opportunistic Bond	USD	6.290.059	9,62 %	7.458.139	9,80 %
Global Real Estate Securities	USD	2.025.945	9,90 %	3.792.511	9,72 %
Global Sustainable Equity	USD	15.360.342	9,94 %	13.052.448	9,92 %
Global Sustainable Value	USD	5.494.503	9,91 %	4.775.068	9,94 %
High Yield Bond	USD	211.826.233	9,41 %	214.442.381	9,33 %
InnovAsia 5G	USD	2.276.389	9,58 %	1.424.712	9,66 %
Japan Equity Engagement	JPY	1.604.837.483	9,92 %	2.011.077.140	9,79 %
Macro Opportunities FX	EUR	276.814	9,61 %	3.132.477	9,94 %
Multi-Asset Income****	USD	–	–	858.422	7,55 %
Next Generation Mobility	USD	15.282.479	9,30 %	13.848.098	9,36 %
Next Generation Space Economy[2]	USD	1.867.472	9,46 %	798.167	9,40 %
Responsible Asian Debt - Hard Currency	USD	6.033.418	9,44 %	2.017.434	9,33 %
Short Duration Emerging Market Debt	USD	387.324.439	9,79 %	487.580.603	9,51 %
Short Duration High Yield SDG Engagement	USD	68.981.565	9,27 %	53.097.443	9,54 %
Strategic Income	USD	213.789.986	10,59 %	144.106.190	10,89 %
Sustainable Asia High Yield	USD	2.685.127	9,40 %	2.859.917	8,96 %
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	9.209.439	9,42 %	9.214.528	9,38 %
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]	USD	42.646.780	9,56 %	14.670.976	9,26 %
Tactical Macro[1]	USD	2.316.731	8,53 %	–	–
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	95.746.144	9,64 %	79.837.235	9,72 %
Uncorrelated Strategies	USD	97.630.396	6,00 %	206.595.785	6,60 %
Uncorrelated Trading[2]*****	USD	–	–	53.936.721	7,58 %
US Equity	USD	4.700.718	9,55 %	2.909.518	9,25 %
US Equity Index PutWrite	USD	66.969.604	9,19 %	63.457.321	9,33 %
US Large Cap Value	USD	185.257.981	9,55 %	168.949.697	9,56 %
US Long Short Equity	USD	17.344.585	8,87 %	17.625.383	7,96 %
US Multi Cap Opportunities	USD	39.850.146	9,95 %	44.117.461	10,00 %
US Real Estate Securities	USD	52.190.980	9,79 %	62.739.110	9,68 %
US Small Cap	USD	62.290.214	9,83 %	57.949.243	9,78 %
US Small Cap Intrinsic Value	USD	30.173.640	9,38 %	18.688.937	9,63 %

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.
** Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.
*** Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.
**** Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.
***** Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Das sonstige Preisrisiko ist das Risiko, dass sich der Wert der Finanzinstrumente aufgrund von Marktpreisschwankungen (mit Ausnahme solcher, die von Zinsänderungs- oder Währungsrisiken hervorgerufen werden) verändert, sei es, dass diese Änderungen spezifischen Faktoren eines einzelnen Instruments oder seinem Emittenten zuzuordnen sind, oder dass sich alle Faktoren auf alle am Markt gehandelten Instrumente auswirken. Da der Großteil der Finanzinstrumente des Fonds zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen und die Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts in der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst werden, wirken sich Veränderungen der Marktbedingungen unmittelbar auf den Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten aus.

Das Preisrisiko wird durch den Manager gesteuert, indem er in ein diversifiziertes Spektrum von Wertpapieren auf verschiedenen Märkten investiert.

In den nachstehenden Tabellen sind die Preisrisiken der betreffenden Portfolios insgesamt zusammengefasst.

5G Connectivity	**31. Dezember 2023**		**31. Dezember 2022**	
	Marktwert US$	**% des Netto-vermögens**	**Marktwert US$**	**% des Netto-vermögens**
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Chinesischer Yuan Renminbi	2.360.602	0,23	88.330.793	8,90
Euro	81.417.322	7,80	61.082.055	6,15
Hongkong-Dollar	–	–	19.691.830	1,98
Japanischer Yen	102.820.574	9,85	92.855.794	9,35
Neuer taiwanesischer Dollar	90.475.913	8,67	46.686.340	4,70
Südkoreanischer Won	26.816.617	2,57	7.609.911	0,77
US-Dollar	686.624.280	65,80	636.637.996	64,11
	990.515.308	94,92	952.894.719	95,96
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	5.308.901	0,51	8.861.706	0,89

Absolute Return Multi Strategy*	**31. Dezember 2023**		**31. Dezember 2022**	
	Marktwert US$	**% des Netto-vermögens**	**Marktwert US$**	**% des Netto-vermögens**
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	6.311	0,00	6.766	0,00
	6.311	0,00	6.766	0,00

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

China A-Share Equity	**31. Dezember 2023**		**31. Dezember 2022**	
	Marktwert CNY	**% des Netto-vermögens**	**Marktwert CNY**	**% des Netto-vermögens**
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Chinesischer Yuan Renminbi	11.693.754	82,27	14.345.271	88,32
Hongkong-Dollar	1.787.183	12,57	972.422	5,99
	13.480.937	94,84	15.317.693	94,31

China Bond	**31. Dezember 2023**		**31. Dezember 2022**	
	Marktwert CNY	**% des Netto-vermögens**	**Marktwert CNY**	**% des Netto-vermögens**
Zu Handelszwecken gehaltene Einlagenzertifikate:				
Chinesischer Yuan Renminbi	58.557.000	12,76	88.103.380	19,45
US-Dollar	–	–	4.820.965	1,07
	58.557.000	12,76	92.924.345	20,52

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

China Bond (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert CNY	% des Netto-vermögens	Marktwert CNY	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Chinesischer Yuan Renminbi	176.348.979	38,43	163.677.183	36,13
US-Dollar	113.805.135	24,81	108.488.656	23,94
	290.154.114	63,24	272.165.839	60,07
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Chinesischer Yuan Renminbi	95.858.682	20,89	60.073.670	13,26
	444.569.796	96,89	425.163.854	93,85
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	185.388	0,04	1.181.877	0,26

China Equity	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Chinesischer Yuan Renminbi	74.424.135	41,76	130.092.894	40,98
Hongkong-Dollar	76.902.453	43,15	163.724.575	51,58
US-Dollar	20.589.763	11,55	13.032.219	4,11
	171.916.351	96,46	306.849.688	96,67
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	123.876	0,07	282.149	0,09

Climate Innovation[1]	31. Dezember 2023	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:		
Chinesischer Yuan Renminbi	22.928	0,78
Euro	423.545	14,49
Hongkong-Dollar	106.861	3,66
Japanischer Yen	86.566	2,96
Norwegische Krone	7.036	0,24
Britisches Pfund	91.036	3,12
Südkoreanischer Won	228.261	7,81
Schweizer Franken	59.474	2,04
US-Dollar	1.805.691	61,78
	2.831.398	96,88

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

CLO Income	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	4.994.906	2,69	–	–
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	51.280.871	27,62	9.941.110	7,20

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

CLO Income (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen) (Fortsetzung):				
US-Dollar	108.406.204	58,40	102.929.843	74,57
	159.687.075	86,02	112.870.953	81,77
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	12.221.060	6,58	–	–
	176.903.041	95,29	112.870.953	81,77
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(176.733)	(0,09)	1.943.252	1,41

Commodities[2]	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	43.941.161	28,60	39.453.874	45,88
	43.941.161	28,60	39.453.874	45,88
Für den Handel gehaltene Agency Bonds:				
US-Dollar	–	–	10.530.836	12,25
	–	–	10.530.836	12,25
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	77.031.796	50,14	26.223.262	30,49
	120.972.957	78,74	76.207.972	88,62
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	1.363.262	0,88	1.186.450	1,38

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Corporate Hybrid Bond	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	1.095.380.852	58,58	1.059.438.369	59,45
Britisches Pfund	430.873.063	23,05	358.590.800	20,12
US-Dollar	217.329.710	11,62	219.972.176	12,34
	1.743.583.625	93,25	1.638.001.345	91,91
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	10.956.412	0,59	10.317.170	0,58
	1.754.540.037	93,84	1.648.318.515	92,49
Reverse Repurchase Agreements held for trading (Fortsetzung):	–	–	(37.445.575)	(2,10)
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	4.369.046	0,23	16.288.239	0,91

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Developed Market FMP – 2027[1]	31. Dezember 2023	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:		
US-Dollar	135.777.186	98,78
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	39.476	0,03

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

Emerging Market Debt - Hard Currency	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	22.351.770	0,84	14.662.054	0,59
US-Dollar	710.090.994	26,80	770.315.416	30,91
	732.442.764	27,64	784.977.470	31,50
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	457.638.482	17,27	368.795.821	14,80
US-Dollar	1.336.544.120	50,44	1.139.225.120	45,72
	1.794.182.602	67,71	1.508.020.941	60,52
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	17.580.000	0,66	16.110.000	0,65
	2.544.205.366	96,01	2.309.108.411	92,67
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	28.532.535	1,08	25.569.299	1,03

Emerging Market Debt - Local Currency	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Zu Handelszwecken gehaltene Einlagenzertifikate:				
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	18.492.177	1,34
	–	–	18.492.177	1,34
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
Thailändischer Baht	7.548.955	0,59	–	–
US-Dollar	25.792.195	2,00	–	–
	33.341.150	2,59	–	–
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Chinesischer Yuan Renminbi	11.270.480	0,88	7.285.480	0,52
Kolumbianischer Peso	21.548.196	1,67	8.802.670	0,64
Mexikanischer Peso	9.006.924	0,70	6.380.573	0,46
	41.825.600	3,25	22.468.723	1,62
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Chilenischer Peso	27.343.613	2,13	26.104.583	1,88
Chinesischer Yuan Renminbi	82.382.352	6,41	102.801.260	7,42
Kolumbianischer Peso	94.999.458	7,39	74.598.060	5,38
Tschechische Krone	63.651.804	4,95	73.521.592	5,30
Peso Dominikanische Republik	6.712.333	0,52	2.610.187	0,19
Ghanaischer Cedi	1.739.991	0,14	4.108.737	0,30

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung):				
Ungarischer Forint	35.686.547	2,77	5.996.791	0,43
Indonesische Rupiah	134.059.168	10,43	137.097.295	9,89
Japanischer Yen	24.384	0,00	32.421	0,00
Malaysischer Ringgit	117.086.678	9,11	139.277.177	10,05
Mexikanischer Peso	107.932.218	8,39	144.597.744	10,43
Peruanischer Sol	38.254.182	2,97	33.296.058	2,40
Philippinischer Peso	4.998.061	0,39	–	–
Polnischer Zloty	123.314.997	9,59	124.542.085	8,98
Rumänischer neuer Leu	40.252.372	3,13	55.708.597	4,02
Serbischer Dinar	3.648.955	0,28	4.872.169	0,35
Südafrikanischer Rand	122.163.844	9,50	178.596.837	12,88
Thailändischer Baht	65.015.458	5,06	125.927.439	9,08
Türkische Lira	20.116.212	1,56	18.929.286	1,37
Uganda-Schilling	5.747.019	0,45	7.306.313	0,53
US-Dollar	10.942.954	0,85	15.066.161	1,09
Uruguayischer Peso	13.856.086	1,08	2.636.726	0,19
Sambischer Kwacha	4.493.148	0,35	2.725.498	0,20
	1.124.421.834	87,45	1.280.353.016	92,36
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	16.173.300	1,26	15.136.550	1,09
	1.215.761.884	94,55	1.336.450.466	96,41
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	933.685	0,07	(33.615.251)	(2,42)

Emerging Market Debt Blend	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
Thailändischer Baht	1.006.392	0,19	–	–
	1.006.392	0,19	–	–
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Kolumbianischer Peso	6.891.239	1,31	3.398.251	0,72
Euro	1.831.160	0,35	1.032.323	0,22
Mexikanischer Peso	5.189.750	0,98	4.264.869	0,91
US-Dollar	134.165.703	25,47	141.206.810	30,03
	148.077.852	28,11	149.902.253	31,88
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Chilenischer Peso	3.606.443	0,69	2.895.335	0,61
Chinesischer Yuan Renminbi	18.928.714	3,59	15.427.534	3,28
Kolumbianischer Peso	20.288.878	3,85	12.577.245	2,67
Tschechische Krone	15.841.841	3,01	11.315.314	2,41

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung):				
Peso Dominikanische Republik	1.455.729	0,28	624.770	0,13
Euro	20.709.235	3,93	17.857.261	3,80
Ghanaischer Cedi	357.466	0,07	815.776	0,17
Ungarischer Forint	7.575.290	1,44	616.714	0,13
Indonesische Rupiah	29.206.946	5,54	22.600.787	4,81
Malaysischer Ringgit	24.205.015	4,60	22.744.336	4,84
Mexikanischer Peso	21.666.362	4,11	21.682.994	4,61
Peruanischer Sol	10.024.733	1,90	7.750.139	1,65
Philippinischer Peso	1.105.103	0,21	–	–
Polnischer Zloty	26.622.990	5,05	24.290.359	5,17
Rumänischer neuer Leu	8.334.386	1,58	8.837.453	1,88
Serbischer Dinar	790.524	0,15	873.537	0,19
Südafrikanischer Rand	26.084.532	4,95	27.262.285	5,80
Thailändischer Baht	17.287.737	3,28	20.529.539	4,37
Türkische Lira	4.286.125	0,81	3.313.333	0,70
Uganda-Schilling	1.119.625	0,21	1.090.644	0,23
US-Dollar	66.534.442	12,63	63.974.006	13,61
Uruguayischer Peso	2.815.790	0,54	600.568	0,13
Sambischer Kwacha	1.720.200	0,33	432.664	0,09
	330.568.106	62,75	288.112.593	61,28
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	14.297.035	2,72	13.380.558	2,84
	493.949.385	93,77	451.395.404	96,00
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	1.629.543	0,31	(2.073.158)	(0,44)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
Thailändischer Baht	37.793	0,06	–	–
US-Dollar	783.358	1,20	–	–
	821.151	1,26	–	–
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Kolumbianischer Peso	167.215	0,26	–	–
Euro	85.072	0,13	81.235	0,15
Mexikanischer Peso	48.823	0,08	–	–
US-Dollar	8.938.496	13,73	7.430.806	13,69
	9.239.606	14,20	7.512.041	13,84
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Chilenischer Peso	369.265	0,57	375.653	0,69

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung):				
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	2.031.464	3,74
Kolumbianischer Peso	1.612.874	2,48	801.082	1,48
Tschechische Krone	1.120.980	1,72	883.384	1,63
Euro	15.173.869	23,32	12.310.300	22,68
Ungarischer Forint	789.996	1,21	207.182	0,38
Indonesische Rupiah	3.393.637	5,21	2.265.664	4,17
Malaysischer Ringgit	2.375.155	3,65	2.105.774	3,88
Mexikanischer Peso	3.218.001	4,95	2.684.300	4,95
Peruanischer Sol	572.240	0,88	284.758	0,53
Philippinischer Peso	86.705	0,13	–	–
Polnischer Zloty	1.877.970	2,89	1.308.790	2,41
Rumänischer neuer Leu	821.386	1,26	718.745	1,32
Thailändischer Baht	1.903.738	2,93	1.580.752	2,91
US-Dollar	14.720.671	22,63	14.709.282	27,10
Uruguayischer Peso	230.078	0,35	18.744	0,04
	48.266.565	74,18	42.285.874	77,91
	58.327.322	89,64	49.797.915	91,75
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	2.496.697	3,84	557.983	1,03

Emerging Markets Equity	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Brasilianischer Real	4.893.129	5,39	7.583.703	3,95
Kanadischer Dollar	527.363	0,58	1.690.432	0,88
Chinesischer Yuan Renminbi	4.639.922	5,12	22.324.279	11,64
Hongkong-Dollar	10.314.095	11,37	37.055.894	19,32
Ungarischer Forint	1.548.368	1,71	2.147.576	1,12
Indische Rupie	16.879.717	18,61	32.046.728	16,71
Indonesische Rupiah	1.597.980	1,76	2.888.935	1,51
Mexikanischer Peso	2.453.962	2,71	2.870.110	1,50
Neuer taiwanesischer Dollar	6.570.941	7,25	11.740.474	6,12
Philippinischer Peso	1.641.571	1,81	–	–
Polnischer Zloty	986.834	1,09	2.615.773	1,36
Britisches Pfund	2.327.741	2,57	4.132.511	2,15
Katar-Rial	–	–	1.894.532	0,99
Saudi-Arabischer Riyal	3.794.106	4,18	6.654.852	3,47
Südafrikanischer Rand	1.094.907	1,21	5.910.698	3,08
Südkoreanischer Won	10.425.157	11,50	21.051.735	10,98
Thailändischer Baht	846.746	0,93	992.701	0,52
VAE-Dirham	1.522.134	1,68	2.750.497	1,43

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung):				
US-Dollar	15.238.027	16,80	22.382.576	11,67
	87.302.700	96,27	188.734.006	98,40
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
Mexikanischer Peso	481.105	0,53	–	–
	87.783.805	96,80	188.734.006	98,40
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	485.257	0,53	386.954	0,20

Emerging Markets Select Equity*	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Brasilianischer Real	–	–	2.793.292	2,98
Chinesischer Yuan Renminbi	–	–	9.457.406	10,09
Hongkong-Dollar	–	–	19.787.346	21,10
Indische Rupie	–	–	7.608.229	8,11
Indonesische Rupiah	–	–	2.132.626	2,27
Mexikanischer Peso	–	–	1.624.815	1,73
Neuer taiwanesischer Dollar	–	–	13.804.257	14,72
Polnischer Zloty	–	–	1.515.194	1,62
Britisches Pfund	–	–	1.390.895	1,48
Katar-Rial	–	–	1.034.075	1,10
Saudi-Arabischer Riyal	–	–	1.404.943	1,50
Südafrikanischer Rand	–	–	3.006.465	3,21
Südkoreanischer Won	–	–	11.727.350	12,51
Thailändischer Baht	–	–	756.239	0,81
VAE-Dirham	–	–	1.362.386	1,45
US-Dollar	–	–	11.021.461	11,76
	–	–	90.426.979	96,44

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

Euro Bond	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert EUR	% des Nettovermögens	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	4.100	0,04	462.816	4,98
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	4.770.071	45,11	4.079.176	43,88
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	5.399.389	51,07	4.005.023	43,09
	10.173.560	96,22	8.547.015	91,95
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(35.197)	(0,33)	(69.064)	(0,74)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Euro Bond Absolute Return	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	158.727	0,46	2.319.216	4,78
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Dänische Krone	1.314.538	3,86	995.767	2,05
Euro	17.243.626	50,68	22.942.484	47,28
	18.558.164	54,54	23.938.251	49,33
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Tschechische Krone	400.377	1,18	–	–
Euro	13.029.635	38,29	19.650.553	40,49
Polnischer Zloty	1.026.138	3,02	–	–
	14.456.150	42,49	19.650.553	40,49
	33.173.041	97,49	45.908.020	94,60
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(1.402.468)	(4,12)	332.738	0,69

European High Yield Bond	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	2.200.101	0,54	–	–
US-Dollar	225.240	0,05	215.121	0,66
	2.425.341	0,59	215.121	0,66
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	325.684.785	79,74	28.338.871	87,32
Britisches Pfund	58.748.951	14,39	3.726.129	11,48
	384.433.736	94,13	32.065.000	98,80
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
Euro	114.727	0,03	202.519	0,63
	386.973.804	94,75	32.482.640	100,09
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(620.006)	(0,15)	(1.854.475)	(5,72)

European Sustainable Equity	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Dänische Krone	13.482.070	7,83	8.595.893	4,89
Euro	84.501.324	49,10	81.995.074	46,63
Norwegische Krone	5.211.834	3,03	7.133.274	4,06
Britisches Pfund	24.298.381	14,12	24.444.336	13,90
Schwedische Krone	10.498.731	6,10	13.773.588	7,83

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

European Sustainable Equity (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien (Fortsetzung):				
Schweizer Franken	31.043.956	18,04	35.431.220	20,15
US-Dollar	2.189.494	1,27	3.015.442	1,71
	171.225.790	99,49	174.388.827	99,17

Event Driven[2]	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	115.039.719	91,00	33.823.354	81,61
	115.039.719	91,00	33.823.354	81,61
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	4.862.107	3,85	917.817	2,21

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Global Bond	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Agency Bonds:				
US-Dollar	1.146.538	1,05	2.423.190	1,80
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	2.971.034	2,73	2.228.563	1,65
Britisches Pfund	670.026	0,62	1.289.899	0,96
US-Dollar	7.223.446	6,64	5.343.245	3,96
	10.864.506	9,99	8.861.707	6,57
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Kanadischer Dollar	–	–	1.022.908	0,76
Dänische Krone	1.030.253	0,95	–	–
Euro	6.226.360	5,73	10.341.319	7,67
Britisches Pfund	1.678.151	1,54	1.763.306	1,31
US-Dollar	19.920.838	18,32	31.231.661	23,16
	28.855.602	26,54	44.359.194	32,90
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Australischer Dollar	1.422.394	1,31	9.709	0,01
Kanadischer Dollar	2.436.049	2,24	10.329.838	7,66
Euro	18.727.042	17,22	9.397.938	6,97
Indonesische Rupiah	2.422.585	2,23	1.164.003	0,86
Japanischer Yen	4.550.365	4,19	5.959.363	4,42
Mexikanischer Peso	819.455	0,75	2.872.675	2,13
Neuseeländischer Dollar	682.094	0,63	1.604.915	1,19
Polnischer Zloty	302.813	0,28	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global Bond (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung):				
Britisches Pfund	2.448.473	2,25	2.840.463	2,11
Südkoreanischer Won	2.429.774	2,23	5.630.012	4,18
Schweizer Franken	399.725	0,37	–	–
US-Dollar	5.840.805	5,37	13.861.093	10,28
	42.481.574	39,07	53.670.009	39,81
Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities:				
US-Dollar	22.645.649	20,82	19.062.981	14,14
Für den Handel gehaltene Kommunalanleihen:				
US-Dollar	1.278.776	1,18	1.706.806	1,27
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	–	–	791.814	0,59
	107.272.645	98,65	130.875.701	97,08
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	12.036	0,01	797.126	0,59

Global Diversified Income FMP – 2024	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	18.765.889	12,01	–	–
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	123.463.985	79,04	150.336.737	93,73
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
US-Dollar	1.727.993	1,11	3.931.136	2,45
	143.957.867	92,16	154.267.873	96,18
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	281.732	0,18	523.570	0,33

Global Equity Megatrends	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Kanadischer Dollar	5.599.812	3,88	4.945.150	6,23
Britisches Pfund	7.576.699	5,24	4.451.857	5,61
US-Dollar	128.316.090	88,81	70.068.328	88,31
	141.492.601	97,93	79.465.335	100,15
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	444	0,00	–	–

Global Flexible Credit Income	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	6.022.083	1,54	5.247.334	1,33

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
US-Dollar	23.118.219	5,92	24.079.041	6,10
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	63.284.923	16,20	55.474.132	14,06
Britisches Pfund	10.735.064	2,75	10.688.891	2,71
US-Dollar	222.253.475	56,90	250.001.101	63,37
	296.273.462	75,85	316.164.124	80,14
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	1.992.091	0,51	1.976.528	0,50
US-Dollar	13.387.657	3,43	7.841.259	1,99
	15.379.748	3,94	9.817.787	2,49
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	15.105.874	3,87	–	–
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	66.832	0,01	338.564	0,08
	355.966.218	91,13	355.646.850	90,14
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	3.511.941	0,90	17.495.741	4,44

Global SDG Engagement	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	96.138.657	17,23	47.186.640	14,00
Britisches Pfund	17.609.057	3,14	6.749.530	2,01
US-Dollar	418.751.767	75,03	219.069.164	65,01
	532.499.481	95,40	273.005.334	81,02
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	4.933	0,00	1.013.476	0,31
	532.504.414	95,40	274.018.810	81,33
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	5.197.440	0,93	3.460.687	1,02

Global High Yield Sustainable Action*	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	–	–	3.765.913	25,03
Britisches Pfund	–	–	792.792	5,27
US-Dollar	–	–	9.884.966	65,69
	–	–	14.443.671	95,99

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global High Yield Sustainable Action* (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	–	–	95.881	0,64
	–	–	14.539.552	96,63
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	–	–	(350.409)	(2,33)

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Kanadischer Dollar	2.045.372	2,36	1.894.286	2,21
Euro	17.112.649	19,72	17.214.963	20,04
Britisches Pfund	6.421.929	7,40	4.004.142	4,66
US-Dollar	55.796.371	64,30	57.653.972	67,11
	81.376.321	93,78	80.767.363	94,02
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	758.536	0,87	–	–
US-Dollar	1.323.918	1,53	2.758.010	3,21
	2.082.454	2,40	2.758.010	3,21
	83.458.775	96,18	83.525.373	97,23
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(1.106.335)	(1,28)	(1.626.695)	(1,90)

Global Opportunistic Bond	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Agency Bonds:				
US-Dollar	–	–	307.820	0,40
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	384.235	0,59	616.355	0,81
Britisches Pfund	67.935	0,10	91.718	0,12
US-Dollar	1.365.573	2,09	3.582.029	4,71
	1.817.743	2,78	4.290.102	5,64
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	17.426.821	26,65	24.004.584	31,54
Britisches Pfund	4.452.439	6,80	3.799.491	4,99
US-Dollar	5.532.795	8,46	7.627.624	10,02
	27.412.055	41,91	35.431.699	46,55
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Australischer Dollar	806.754	1,23	–	–
Chinesischer Yuan Renminbi	1.976.796	3,02	3.581.244	4,70
Tschechische Krone	514.023	0,79	413.371	0,54

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen (Fortsetzung):				
Euro	5.428.488	8,29	5.925.902	7,79
Ungarischer Forint	288.139	0,44	–	–
Indonesische Rupiah	1.613.604	2,47	324.042	0,42
Japanischer Yen	–	–	106.443	0,14
Mexikanischer Peso	2.891.430	4,42	1.444.773	1,90
Neuseeländischer Dollar	3.053.390	4,67	3.726.450	4,90
Polnischer Zloty	980.709	1,50	347.647	0,46
Britisches Pfund	413.338	0,63	465.305	0,61
Südkoreanischer Won	258.205	0,40	–	–
Thailändischer Baht	267.740	0,41	265.740	0,35
US-Dollar	2.640.767	4,04	8.110.126	10,66
	21.133.383	32,31	24.711.043	32,47
Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities:				
US-Dollar	14.565.802	22,27	10.458.233	13,74
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	21.165	0,03	107.216	0,14
US-Dollar	–	–	1.694.000	2,23
	21.165	0,03	1.801.216	2,37
	64.950.148	99,30	77.000.113	101,17
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(2.049.562)	(3,14)	(2.418.728)	(3,18)

Global Real Estate Securities	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Kanadischer Dollar	117.134	0,57	–	–
Euro	157.095	0,77	967.525	2,48
Hongkong-Dollar	788.347	3,86	2.886.361	7,40
Japanischer Yen	729.085	3,56	1.896.887	4,86
Britisches Pfund	383.800	1,87	–	–
Singapur-Dollar	535.593	2,62	1.095.282	2,81
Schweizer Franken	304.936	1,49	–	–
	3.015.990	14,74	6.846.055	17,55
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
Australischer Dollar	1.038.510	5,08	1.287.061	3,30
Kanadischer Dollar	710.266	3,47	1.814.574	4,65
Euro	1.332.446	6,51	964.954	2,47
Hongkong-Dollar	162.068	0,79	165.184	0,42
Japanischer Yen	1.009.965	4,94	1.709.702	4,38
Britisches Pfund	799.443	3,91	3.081.950	7,90

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global Real Estate Securities (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften (Fortsetzung):				
Singapur-Dollar	199.240	0,97	404.924	1,04
US-Dollar	11.819.730	57,77	20.932.449	53,64
	17.071.668	83,44	30.360.798	77,80
	20.087.658	98,18	37.206.853	95,35
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	171.794	0,84	718.252	1,84

Global Sustainable Equity	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Dänische Krone	2.356.638	1,52	2.087.272	1,59
Euro	17.578.770	11,37	13.586.367	10,32
Japanischer Yen	2.808.506	1,82	1.579.691	1,20
Norwegische Krone	3.832.389	2,48	4.294.333	3,26
Britisches Pfund	4.527.650	2,93	4.178.560	3,18
Schwedische Krone	4.357.908	2,82	3.754.615	2,85
Schweizer Franken	12.094.419	7,82	5.969.089	4,54
US-Dollar	106.047.139	68,61	95.074.555	72,26
	153.603.419	99,37	130.524.482	99,20

Global Sustainable Value	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Australischer Dollar	1.631.790	2,94	1.063.750	2,21
Brasilianischer Real	566.280	1,02	260.528	0,54
Kanadischer Dollar	2.053.991	3,70	1.782.255	3,71
Dänische Krone	–	–	259.180	0,54
Euro	4.792.613	8,65	4.046.608	8,42
Hongkong-Dollar	1.646.031	2,97	1.631.434	3,40
Indonesische Rupiah	192.941	0,35	291.610	0,61
Japanischer Yen	3.141.436	5,66	2.696.878	5,62
Mexikanischer Peso	397.431	0,72	180.675	0,38
Neuer taiwanesischer Dollar	1.041.760	1,88	796.265	1,66
Neuseeländischer Dollar	110.969	0,20	63.031	0,13
Norwegische Krone	364.222	0,66	57.477	0,12
Britisches Pfund	2.659.501	4,80	2.087.872	4,35
Singapur-Dollar	245.963	0,44	–	–
Südafrikanischer Rand	199.332	0,36	370.092	0,77
Südkoreanischer Won	794.977	1,43	880.568	1,83
Schwedische Krone	133.986	0,24	383.756	0,80
Schweizer Franken	1.191.665	2,15	1.186.730	2,47
US-Dollar	32.644.183	58,84	28.921.680	60,23
	53.809.071	97,01	46.960.389	97,79

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Global Sustainable Value (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
Australischer Dollar	50.247	0,09	133.123	0,28
Euro	65.321	0,12	101.504	0,21
Britisches Pfund	21.788	0,04	108.028	0,22
US-Dollar	979.048	1,77	412.782	0,86
	1.116.404	2,02	755.437	1,57
	54.925.475	99,03	47.715.826	99,36
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	19.551	0,04	34.856	0,07

High Yield Bond	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
US-Dollar	10.897.982	0,49	21.830.306	0,95
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	–	–	3.839.814	0,16
US-Dollar	1.999.177.351	88,78	1.978.713.612	86,08
	1.999.177.351	88,78	1.982.553.426	86,24
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
US-Dollar	36.225.768	1,61	–	–
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	43.084.058	1,91	91.635.501	3,99
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	3.611.285	0,16	18.294.706	0,80
	2.092.996.444	92,95	2.114.313.939	91,98
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	25.265.889	1,12	30.109.875	1,31

InnovAsia 5G	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Australischer Dollar	173.907	0,73	–	–
Chinesischer Yuan Renminbi	1.007.839	4,24	2.183.240	14,80
Hongkong-Dollar	–	–	212.641	1,44
Indische Rupie	2.729.942	11,49	539.135	3,66
Japanischer Yen	6.224.873	26,19	3.928.339	26,64
Malaysischer Ringgit	481.076	2,02	319.895	2,17
Neuer taiwanesischer Dollar	5.480.052	23,05	3.802.814	25,78
Singapur-Dollar	563.158	2,37	505.401	3,43
Südkoreanischer Won	3.391.560	14,27	515.684	3,50

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien (Fortsetzung):				
Thailändischer Baht	715.164	3,01	–	–
US-Dollar	1.208.522	5,08	1.472.362	9,98
Vietnamesischer Dong	548.794	2,31	392.997	2,66
	22.524.887	94,76	13.872.508	94,06
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	238.999	1,01	374.607	2,54

Japan Equity Engagement	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert JPY	% des Netto-vermögens	Marktwert JPY	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Japanischer Yen	15.961.893.000	98,67	20.207.455.300	98,37
	15.961.893.000	98,67	20.207.455.300	98,37
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	86.481.827	0,53	(96.683.905)	(0,47)

Macro Opportunities FX	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
Euro	2.407.376	83,54	4.389.983	13,93
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	–	–	24.967.521	79,24
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	347.166	12,04	2.778.639	8,82
	2.754.542	95,58	32.136.143	101,99
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	13.600	0,48	(811.369)	(2,58)

Multi-Asset Income*	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Agency Bonds:				
US-Dollar	–	–	7.644	0,07
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	–	–	2.941.980	25,88
Britisches Pfund	–	–	213.717	1,88
US-Dollar	–	–	1.725.211	15,18
	–	–	4.880.908	42,94
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Australischer Dollar	–	–	43.240	0,38
Brasilianischer Real	–	–	17.407	0,15
Euro	–	–	151.800	1,34

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Multi-Asset Income* (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien (Fortsetzung):				
Hongkong-Dollar	–	–	98.904	0,87
Japanischer Yen	–	–	108.100	0,95
Neuer taiwanesischer Dollar	–	–	23.212	0,20
Britisches Pfund	–	–	73.519	0,65
Südafrikanischer Rand	–	–	8.339	0,07
Südkoreanischer Won	–	–	30.543	0,27
Schweizer Franken	–	–	46.212	0,41
US-Dollar	–	–	2.247.172	19,77
	–	–	2.848.448	25,06
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
US-Dollar	–	–	311.601	2,74
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	–	–	8.560	0,08
US-Dollar	–	–	593.625	5,22
	–	–	602.185	5,30
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
Südafrikanischer Rand	–	–	2.166	0,02
US-Dollar	–	–	362.642	3,19
	–	–	364.808	3,21
	–	–	9.015.594	79,32
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	–	–	(431.372)	(3,80)

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Next Generation Mobility	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Kanadischer Dollar	923.624	0,56	2.312.662	1,56
Chinesischer Yuan Renminbi	821.040	0,50	1.537.306	1,04
Euro	8.462.265	5,15	5.688.591	3,84
Hongkong-Dollar	3.671.609	2,23	3.880.762	2,62
Japanischer Yen	3.261.498	1,98	2.867.915	1,94
Neuer taiwanesischer Dollar	1.653.606	1,01	1.016.740	0,69
Südkoreanischer Won	1.389.795	0,85	–	–
Schwedische Krone	2.040.128	1,24	1.854.267	1,25
US-Dollar	128.971.071	78,47	117.719.542	79,54
	151.194.636	91,99	136.877.785	92,48
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	1.619.728	0,99	1.522.531	1,03
	152.814.364	92,98	138.400.316	93,51
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	10.424	0,00	80.667	0,06

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Next Generation Space Economy[2]	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Chinesischer Yuan Renminbi	291.964	1,48	103.745	1,22
Euro	2.149.013	10,88	1.179.050	13,89
Japanischer Yen	1.343.794	6,81	172.026	2,03
Neuer taiwanesischer Dollar	190.613	0,96	134.551	1,58
Britisches Pfund	714.841	3,62	357.829	4,21
Singapur-Dollar	591.271	2,99	270.258	3,18
Südkoreanischer Won	1.016.293	5,15	288.684	3,40
US-Dollar	12.376.927	62,69	5.475.531	64,49
	18.674.716	94,58	7.981.674	94,00

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Responsible Asian Debt - Hard Currency	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	2.496.736	3,90	–	–
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	45.692.223	71,46	18.090.069	83,65
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	2.185.563	3,42	633.146	2,93
US-Dollar	9.839.633	15,39	1.457.840	6,74
	12.025.196	18,81	2.090.986	9,67
	60.214.155	94,17	20.181.055	93,32
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	120.024	0,19	(6.712)	(0,03)

Short Duration Emerging Market Debt	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	53.894.704	1,36	51.075.667	1,00
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	10.195.525	0,26	41.269.865	0,81
US-Dollar	2.396.291.848	60,59	3.486.415.742	68,03
	2.406.487.373	60,85	3.527.685.607	68,84
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	362.400.411	9,17	225.469.117	4,40
US-Dollar	945.231.530	23,90	980.358.585	19,13
	1.307.631.941	33,07	1.205.827.702	23,53
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
US-Dollar	49.810.000	1,26	70.347.000	1,37
	3.817.824.018	96,54	4.854.935.976	94,74
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	–	–	(1.843.240)	(0,04)
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	55.420.371	1,40	22.713.291	0,44

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Short Duration High Yield SDG Engagement	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	–	–	10.810.063	1,94
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	664.013.737	89,20	477.638.711	85,85
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	13.420.047	1,80	23.578.927	4,24
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	241.028	0,03	1.221.039	0,22
	677.674.812	91,03	513.248.740	92,25
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	12.140.835	1,63	17.725.693	3,18

Strategic Income	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	22.512	0,00	–	–
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	221.166.130	10,95	8.017.122	0,61
Für den Handel gehaltene Agency Bonds:				
US-Dollar	781.434	0,04	772.053	0,06
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
US-Dollar	211.031.917	10,45	105.467.359	7,97
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	82.785.192	4,10	30.404.992	2,30
Britisches Pfund	20.389.514	1,01	5.246.297	0,40
US-Dollar	432.669.604	21,42	601.915.888	45,50
	535.844.310	26,53	637.567.177	48,20
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Kolumbianischer Peso	2.200.755	0,11	1.405.082	0,11
Ungarischer Forint	2.620.824	0,13	1.753.111	0,13
Indonesische Rupiah	3.750.751	0,19	3.588.355	0,27
Mexikanischer Peso	6.951.252	0,34	2.721.504	0,21
Peruanischer Sol	4.098.321	0,20	4.407.353	0,33
Polnischer Zloty	2.823.563	0,14	–	–
Rumänischer neuer Leu	4.056.767	0,20	–	–
Südafrikanischer Rand	2.180.039	0,11	1.824.633	0,14
Türkische Lira	–	–	1.705.418	0,13
US-Dollar	146.987.608	7,28	225.951.909	17,08
	175.669.880	8,70	243.357.365	18,40
Für den Handel gehaltene Mortgage-Backed Securities:				
US-Dollar	918.338.562	45,47	346.893.475	26,22

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Strategic Income (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Kommunalanleihen:				
US-Dollar	12.918.823	0,64	20.744.098	1,57
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	429.819	0,02	579.804	0,04
Für den Handel gehaltene Investmentfonds:				
Britisches Pfund	145.814	0,01	738.685	0,05
US-Dollar	60.620.640	3,00	57.487.152	4,35
	60.766.454	3,01	58.225.837	4,40
	2.136.969.841	105,81	1.421.624.290	107,47
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	930.018	0,04	19.437.605	1,47

Sustainable Asia High Yield	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	24.364.117	85,29	27.495.016	86,13
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
US-Dollar	2.505.094	8,77	837.924	2,63
	26.869.211	94,06	28.332.940	88,76
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(17.944)	(0,06)	266.230	0,83

Sustainable Emerging Market Corporate Debt	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	83.464.415	85,35	86.982.672	88,54
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	3.224.557	3,30	2.325.515	2,37
US-Dollar	3.943.827	4,03	2.075.893	2,11
	7.168.384	7,33	4.401.408	4,48
	90.632.799	92,68	91.384.080	93,02
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	1.461.588	1,50	761.197	0,77

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	28.120.429	6,31	7.708.197	4,87
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	157.346.786	35,29	40.133.656	25,33
US-Dollar	230.334.993	51,65	95.972.503	60,58
	387.681.779	86,94	136.106.159	85,91
	415.802.208	93,25	143.814.356	90,78
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	10.665.593	2,39	2.895.404	1,83

Tactical Macro[1]	31. Dezember 2023	
	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:		
US-Dollar	22.994.103	84,66
	22.994.103	84,66
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	173.202	0,63

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Ultra Short Term Euro Bond	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens	Marktwert EUR	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
Euro	8.960.964	0,90	–	–
Für den Handel gehaltene forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen):				
Euro	90.687.160	9,14	72.343.961	8,81
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	789.167.617	79,48	670.503.994	81,63
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Euro	75.386.047	7,59	56.450.113	6,87
	964.201.788	97,11	799.298.068	97,31
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(6.740.350)	(0,68)	(925.722)	(0,12)

Uncorrelated Strategies	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	Marktwert US$	Marktwert US$	% des Netto-vermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Euro	1.692.087	0,10	1.951.285	0,07
Japanischer Yen	–	–	694.532	0,02
Schweizer Franken	31.648	0,00	–	–
US-Dollar	75.568.717	4,65	132.722.211	4,23
	77.292.452	4,75	135.368.028	4,32
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	1.217.656	0,07	4.976.282	0,16

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	Marktwert US$	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Participatory Notes:				
Euro	2.209	0,00	6.404	0,00
Britisches Pfund	14.342	0,00	15.036	0,00
US-Dollar	20.494	0,00	–	–
	37.045	0,00	21.440	0,00
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:				
US-Dollar	707.195.701	43,48	1.582.793.462	50,57
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro	668.976	0,04	26.126.967	0,84
Japanischer Yen	1.549.865	0,09	–	–
Britisches Pfund	–	–	3.685.493	0,12
US-Dollar	118.399.986	7,28	131.574.600	4,20
	120.618.827	7,41	161.387.060	5,16
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
Polnischer Zloty	2.810.381	0,17	–	–
Südafrikanischer Rand	13.608.831	0,84	–	–
US-Dollar	22.545.359	1,39	4.218.750	0,13
	38.964.571	2,40	4.218.750	0,13
	945.326.252	58,11	1.888.765.022	60,34
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	30.977.706	1,91	177.192.829	5,66

Uncorrelated Trading[2]*	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	–	–	16.089.324	2,26
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:	–	–		
US-Dollar	–	–	3.946.436	0,55
Für den Handel gehaltene Schatzwechsel:	–	–		
US-Dollar	–	–	449.200.010	63,10
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
Euro			5.556.545	0,78
Britisches Pfund	–	–	921.374	0,13
US-Dollar			6.743.516	0,95
	–	–	13.221.435	1,86
	–	–	482.457.205	67,77
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	–	–	56.910.001	7,99

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

US Equity	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	45.872.647	93,23	27.005.260	85,83
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	–	–	478.769	1,52
	45.872.647	93,23	27.484.029	87,35
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	1.134.529	2,31	1.611.149	5,12

US Equity Index PutWrite	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Staatsanleihen:				
US-Dollar	663.357.136	90,98	632.264.076	92,92
	663.357.136	90,98	632.264.076	92,92
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	6.338.906	0,88	2.309.131	0,34

US Large Cap Value	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	1.847.675.317	95,28	1.688.625.847	95,51
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	3.901.309	0,20	–	–
	1.851.576.626	95,48	1.688.625.847	95,51
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	1.003.185	0,05	871.125	0,05

US Long Short Equity	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
Euro	1.648.923	0,84	1.265.964	0,57
US-Dollar	164.934.480	84,38	156.744.366	70,76
	166.583.403	85,22	158.010.330	71,33
Für den Handel gehaltene Participatory Notes:				
US-Dollar	–	–	3.750	0,00
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	3.534.047	1,81	1.744.930	0,79
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	7.670.535	3,92	8.400.448	3,79
Für den Handel gehaltene mittelfristige Schuldverschreibungen:				
US-Dollar	487.831	0,25	–	–
	178.275.816	91,20	168.159.458	75,91
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(4.829.968)	(2,47)	8.094.369	3,66

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(a) Preisänderungsrisiko (Fortsetzung)

US Multi Cap Opportunities	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	396.982.739	99,12	439.025.865	99,48
	396.982.739	99,12	439.025.865	99,48
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	1.518.722	0,38	2.148.740	0,49

US Real Estate Securities	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	519.992.632	97,54	624.531.489	96,38
	519.992.632	97,54	624.531.489	96,38
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	1.917.164	0,36	2.859.608	0,44

US Small Cap	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	622.291.910	98,17	578.779.674	97,70
	622.291.910	98,17	578.779.674	97,70
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	610.226	0,10	712.758	0,12

US Small Cap Intrinsic Value	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
	Marktwert US$	% des Nettovermögens	Marktwert US$	% des Nettovermögens
Für den Handel gehaltene Aktien:				
US-Dollar	299.826.372	93,24	184.718.734	95,19
Für den Handel gehaltene Immobilienaktiengesellschaften:				
US-Dollar	1.910.421	0,59	2.170.638	1,12
Für den Handel gehaltene Unternehmensanleihen:				
US-Dollar	0	0,00	–	–
	301.736.793	93,83	186.889.372	96,31
Zu Handelszwecken gehaltene Derivate, netto	(398)	(0,00)	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko

Der Nettoinventarwert je Anteil eines Portfolios wird in der Basiswährung des betreffenden Portfolios berechnet. Anlagen, die für Rechnung des Portfolios gehalten werden, können jedoch in anderen Währungen erworben werden. Der Wert der Basiswährung der Anlagen eines auf eine andere Währung lautenden Portfolios kann aufgrund von Währungsschwankungen in Bezug auf die jeweiligen Währungen steigen oder fallen. Nachteilige Veränderungen der Wechselkurse können zu einer Verringerung der Rendite und einem Kapitalverlust führen. Die Positionen werden täglich überwacht, und es werden Absicherungsstrategien zur Sicherstellung eingesetzt, dass die Positionen innerhalb festgelegter Limits bleiben.

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hätten bei einem Anstieg der Basiswährung des betreffenden Portfolios gegenüber allen Währungen um 5 % und bei gleichzeitiger Konstanz aller anderen Variablen das Nettovermögen und die Veränderung des Nettovermögens gemäß Gewinn- und Verlustrechnung wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt (abgenommen)/zugenommen.

Portfolio	Währung	31. Dezember 2023	% des Nettover-mögens	31. Dezember 2022	% des Nettover-mögens
5G Connectivity	USD	15.448.010	1,48 %	16.196.327	1,63 %
China A-Share Equity	CNY	664.105	4,67 %	766.150	4,72 %
China Bond	CNY	14.705.878	3,20 %	5.708.838	1,26 %
China Equity	USD	7.902.362	4,43 %	15.222.965	4,80 %
Climate Innovation[2]	USD	51.253	1,75 %	-	-
CLO Income	USD	2.552.853	1,38 %	611.238	0,44 %
Commodities[1]	USD	90.805	0,06 %	59.977	0,07 %
Corporate Hybrid Bond	EUR	37.063.252	1,98 %	35.490.162	1,99 %
Developed Market FMP – 2027[2]	USD	1.974	0,00 %	-	-
Emerging Market Debt – Hard Currency	USD	27.540.375	1,04 %	22.052.213	0,89 %
Emerging Market Debt – Local Currency	USD	57.903.637	4,50 %	63.850.053	4,61 %
Emerging Market Debt Blend	USD	13.736.311	2,61 %	12.004.568	2,55 %
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	1.867.386	2,87 %	1.470.659	2,71 %
Emerging Markets Equity	USD	3.657.753	4,03 %	8.346.156	4,35 %
Emerging Markets Select Equity*	USD	201	0,00 %	3.972.405	4,24 %
Euro Bond	EUR	(471)	0,00 %	(572)	(0,01 %)
Euro Bond Absolute Return	EUR	74.833	0,22 %	685.901	1,41 %
European High Yield Bond	EUR	2.923.587	0,72 %	151.849	0,47 %
European Sustainable Equity	EUR	4.362.047	2,53 %	4.591.665	2,61 %
Event Driven[1]	USD	209.067	0,17 %	45.069	0,11 %
Global Bond	USD	2.550.381	2,35 %	2.992.478	2,22 %
Global Diversified Income FMP – 2024	USD	14.086	0,01 %	26.179	0,02 %
Global Equity Megatrends	USD	670.810	0,46 %	470.294	0,59 %
Global Flexible Credit Income	USD	3.927.885	1,01 %	4.319.726	1,09 %
Global SDG Engagement	USD	5.963.760	1,07 %	2.865.536	0,85 %
Global High Yield Sustainable Action*	USD	36	0,00 %	211.087	1,40 %
Global Investment Grade Credit	USD	1.327.438	1,53 %	1.170.010	1,36 %
Global Opportunistic Bond	USD	2.039.335	3,12 %	2.273.392	2,99 %
Global Real Estate Securities	USD	422.417	2,06 %	850.597	2,18 %
Global Sustainable Equity	USD	2.410.032	1,56 %	1.772.787	1,35 %
Global Sustainable Value	USD	1.066.592	1,92 %	921.286	1,92 %
High Yield Bond	USD	1.650.638	0,07 %	3.112.894	0,14 %
InnovAsia 5G	USD	1.076.997	4,53 %	638.402	4,33 %
Japan Equity Engagement	JPY	4.663.754	0,03 %	(8.146.918)	(0,04 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

Portfolio	Währung	31. Dezember 2023	% des Nettover-mögens	31. Dezember 2022	% des Nettover-mögens
Macro Opportunities FX	EUR	2.121	0,07 %	(39.764)	(0,13 %)
Multi-Asset Income*	USD	-	0,00 %	182.057	1,60 %
Next Generation Mobility	USD	1.100.784	0,67 %	971.244	0,66 %
Next Generation Space Economy[1]	USD	323.291	1,64 %	125.136	1,47 %
Responsible Asian Debt – Hard Currency	USD	118.753	0,19 %	32.863	0,15 %
Short Duration Emerging Market Debt	USD	22.091.968	0,56 %	16.156.419	0,32 %
Short Duration High Yield SDG Engagement	USD	761.620	0,10 %	1.001.077	0,18 %
Strategic Income	USD	9.712.500	0,48 %	3.809.057	0,29 %
Sustainable Asia High Yield	USD	932	0,00 %	12.741	0,04 %
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	247.125	0,25 %	38.780	0,04 %
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[1]	USD	8.390.584	1,88 %	2.325.609	1,47 %
Tactical Macro[2]	USD	(3.431)	(0,01 %)	-	-
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	(108.980)	(0,01 %)	(314.975)	(0,04 %)
Uncorrelated Strategies	USD	5.921.898	0,36 %	7.030.682	0,22 %
Uncorrelated Trading[1]*	USD	(11)	0,00 %	3.480.578	0,49 %
US Equity	USD	56.878	0,12 %	80.558	0,26 %
US Equity Index PutWrite	USD	571.074	0,08 %	785.232	0,12 %
US Large Cap Value	USD	72.229	0,00 %	79.926	0,00 %
US Long Short Equity	USD	210.821	0,11 %	338.890	0,15 %
US Multi Cap Opportunities	USD	57.658	0,01 %	106.892	0,02 %
US Real Estate Securities	USD	96.763	0,02 %	137.254	0,02 %
US Small Cap	USD	36.361	0,01 %	39.073	0,01 %
US Small Cap Intrinsic Value	USD	13.463	0,00 %	10.357	0,01 %

[1] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.
[2] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
* Der Teilfonds wurde während des aktuellen oder vorherigen Berichtsjahres aufgelöst.

Eine Abschwächung der Basiswährung des betreffenden Portfolios gegenüber den oben genannten Währungen um 5 % hätte bei Konstanz aller anderen Variablen auf die oben aufgeführten Beträge im Jahresabschluss den entgegengesetzten Effekt in gleicher Höhe gehabt. Das Währungsrisiko wurde auf Basis des Nettovermögens des Portfolios berechnet, das auf eine andere Währung als die Basiswährung des betreffenden Portfolios lautet. Der Manager hält 5 % für einen angemessenen Satz für Wechselkurseffekte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

In den nachstehenden Tabellen sind die Preisrisiken der betreffenden Portfolios insgesamt zusammengefasst.

	5G Connectivity		China A-Share Equity		China Bond	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	CNY	CNY	CNY	CNY
Australischer Dollar	769.833	479.859	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	931.733	918.751	164.728.545	338.866.827
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	2.368.424	88.434.633	11.487.246	14.345.263	175.328.923	-
Euro	84.962.476	68.866.568	-	-	898	1.833
Hongkong-Dollar	(7.935)	16.645.530	1.794.336	977.264	-	-
Japanischer Yen	103.938.608	92.855.666	-	-	-	-
Neuer taiwanesischer Dollar	88.565.742	46.686.340	-	-	-	-
Britisches Pfund	380.189	769.130	-	-	1.322	(3.579)
Singapur-Dollar	875.928	1.578.903	-	-	(8.833)	194
Südafrikanischer Rand	80.837	-	-	-	-	-
Südkoreanischer Won	27.019.657	7.609.911	-	-	-	-
Schweizer Franken	6.442	-	-	-	-	-
US-Dollar	734.566.742	669.083.653	517	480	118.795.253	114.178.304
	1.043.526.943	**993.010.193**	**14.213.832**	**16.241.758**	**458.846.108**	**453.043.579**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	China Equity		Climate Innovation[1]		CLO Income	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Chinesischer Yuan Renminbi	2.855.957	3.234.457	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	74.424.349	128.939.869	22.928	-	-	-
Euro	(3.795)	180.591	423.573	-	50.844.680	10.342.101
Hongkong-Dollar	80.726.155	172.004.521	106.864	-	-	-
Japanischer Yen	-	-	86.565	-	-	-
Norwegische Krone	-	-	7.036	-	-	-
Britisches Pfund	499	870	91.036	-	2.908	1.747.984
Singapur-Dollar	31.240	81.549	-	-	-	-
Südkoreanischer Won	-	-	227.583	-	-	-
Schwedische Krone	-	-	-	-	209.466	134.665
Schweizer Franken	12.827	17.439	59.474	-	-	-
US-Dollar	20.179.055	12.954.380	1.897.496	-	134.589.251	125.812.714
	178.226.287	**317.413.676**	**2.922.555**	**-**	**185.646.305**	**138.037.464**

	Commodities[2]		Corporate Hybrid Bond		Developed Market FMP – 2027[1]	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	EUR	EUR	US$	US$
Australischer Dollar	-	-	71.869	(84.871)	-	-
Euro	-	-	1.128.551.430	1.072.351.561	39.476	-
Britisches Pfund	1.816.095	1.199.530	469.298.379	383.674.609	-	-
Singapur-Dollar	-	-	(11.417)	(11.783)	-	-
Schweizer Franken	-	-	160.617	(429.363)	-	-
US-Dollar	151.830.464	84.797.899	271.745.585	326.654.655	137.418.343	-
	153.646.559	**85.997.429**	**1.869.816.463**	**1.782.154.808**	**137.457.819**	**-**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Emerging Market Debt - Hard Currency		Emerging Market Debt - Local Currency		Emerging Market Debt Blend	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Argentinischer Peso	-	-	2.890	8.677	993	2.982
Australischer Dollar	601.670	172.417	711.720	253.560	94.706	46.451
Brasilianischer Real	-	-	291.529	(18.304.450)	(1.704.435)	(3.013.341)
Kanadischer Dollar	-	-	842	790	279	262
Chilenischer Peso	-	-	26.641.503	20.114.549	3.159.484	1.065.106
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	94.077.109	134.202.029	18.981.129	15.810.305
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	-	-	(382.644)	45.826	(114.012)	18.949
Kolumbianischer Peso	-	-	114.707.095	86.990.761	26.663.057	16.810.382
Tschechische Krone	-	-	62.128.688	72.788.675	15.760.898	11.496.050
Peso Dominikanische Republik	-	-	6.712.333	2.610.187	1.455.729	624.770
Ägyptisches Pfund	-	-	(528.913)	466.870	(68.180)	82.365
Euro	539.044.170	453.159.994	700.146	(1.258.427)	21.297.201	24.578.138
Ghanaischer Cedi	-	-	1.740.612	4.492.772	357.726	936.601
Hongkong-Dollar	6.588	1.272	-	-	-	-
Ungarischer Forint	-	-	35.592.912	(3.848.897)	7.558.875	(1.926.397)
Indische Rupie	-	-	25.342	-	7.083	-
Indonesische Rupiah	-	-	134.135.500	137.041.955	29.227.651	22.589.671
Israelischer Schekel	-	-	(1.992.838)	(843.671)	(424.993)	(136.238)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)		Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)		Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Japanischer Yen	455.988	360.169	24.384	32.421	-	-
Malaysischer Ringgit	-	-	117.522.624	139.683.449	24.310.403	22.805.460
Mexikanischer Peso	-	-	106.797.062	142.845.938	23.835.040	23.413.075
Neuer taiwanesischer Dollar	-	-	(11.844)	(278.813)	(1.736)	(48.237)
Nigerianischer Naira	-	-	4.665	9.088	1.460	2.843
Norwegische Krone	-	-	-	-	912	150
Peruanischer Sol	-	-	38.164.906	33.432.856	9.927.219	7.753.772
Philippinischer Peso	-	-	5.069.836	40.447	1.121.450	6.772
Polnischer Zloty	-	-	122.435.640	125.311.661	27.577.765	32.614.821
Britisches Pfund	1.369.267	(1.179.852)	5.145	(478.553)	102.739	(167.874)
Rumänischer Leu	-	-	40.339.921	56.063.139	8.369.423	8.884.562
Serbischer Dinar	-	-	3.648.955	4.872.169	790.524	873.537
Singapur-Dollar	735.239	149.452	(13.987)	300.469	21.891	197.329
Südafrikanischer Rand	-	-	128.414.178	183.733.684	27.255.355	28.878.918
Südkoreanischer Won	-	-	2.474.058	(219.330)	563.511	47.856
Schwedische Krone	2.044.431	(13.719.192)	27.678	(3.511)	49.257	(863)
Schweizer Franken	6.550.148	2.100.001	-	-	28	25
Thailändischer Baht	-	-	74.428.877	125.999.885	18.604.820	20.526.474
Türkische Lira	-	-	20.116.212	18.221.312	4.286.125	3.192.431
Uganda-Schilling	-	-	5.747.020	7.308.984	1.119.625	1.090.702
US-Dollar	2.099.011.154	2.050.660.667	127.794.917	109.263.391	252.061.592	230.090.129
Uruguayischer Peso	-	-	13.819.761	2.636.726	2.816.774	600.568
Sambischer Kwacha	-	-	4.493.813	2.727.825	1.720.439	432.974
	2.649.818.655	**2.491.704.928**	**1.285.867.647**	**1.386.264.443**	**526.787.807**	**470.181.480**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend		Emerging Markets Equity		Emerging Markets Select Equity*	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Australischer Dollar	371.064	104.537	78.109	64.457	-	-
Brasilianischer Real	-	-	4.904.069	7.586.762	-	2.794.924
Kanadischer Dollar	2	1	779.818	1.755.366	-	7
Chilenischer Peso	367.546	339.178	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	-	2.031.464	50	30.079	-	70.634
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	-	748	4.639.922	22.323.932	-	9.438.596
Kolumbianischer Peso	1.752.964	831.596	-	-	-	-
Tschechische Krone	1.099.304	869.272	-	-	-	-
Euro	16.572.344	13.937.885	48.711	137.273	-	16.195
Hongkong-Dollar	-	-	10.159.509	37.056.247	6	19.787.831
Ungarischer Forint	788.480	124.597	1.548.412	2.147.618	-	-
Indische Rupie	356	-	16.883.306	32.037.144	4.019	7.573.691
Indonesische Rupiah	3.396.336	2.268.124	1.597.980	2.888.935	-	2.132.626
Israelischer Schekel	(43.103)	(10.118)	-	-	-	-
Malaysischer Ringgit	2.398.875	2.125.633	-	-	-	-
Mexikanischer Peso	3.245.080	2.639.163	2.935.064	2.869.765	-	1.624.815
Neuer taiwanesischer Dollar	(787)	(2.682)	6.668.816	11.838.081	-	13.804.257
Norwegische Krone	1.800.411	193.954	-	-	-	-
Peruanischer Sol	575.602	287.425	-	-	-	-
Philippinischer Peso	88.006	550	1.605.757	-	-	-
Polnischer Zloty	1.875.905	1.317.294	986.888	2.615.812	-	1.515.263

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)		Emerging Markets Equity (Fortsetzung)		Emerging Markets Select Equity* (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Britisches Pfund	(4)	(3)	2.349.824	4.164.338	-	1.390.901
Katar-Rial	-	-	-	1.894.532	-	1.034.075
Rumänischer Leu	821.254	719.940	-	-	-	-
Russischer Rubel	-	-	2.953	3.617	-	-
Saudi-Riyal	-	-	4.003.118	6.654.852	-	1.405.056
Singapur-Dollar	(365)	790	2	2	-	1
Südafrikanischer Rand	-	-	1.129.877	6.019.825	-	3.006.541
Südkoreanischer Won	45.767	5.962	10.463.980	21.091.276	-	11.734.068
Thailändischer Baht	1.961.700	1.609.126	846.746	992.701	-	756.239
VAE-Dirham	-	-	1.522.140	2.750.497	-	1.362.386
US-Dollar	27.719.825	24.861.201	17.532.450	24.884.644	(4.025)	14.314.016
Uruguayischer Peso	230.987	18.744	-	-	-	-
	65.067.549	**54.274.381**	**90.687.501**	**191.807.755**	**-**	**93.762.122**

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Euro Bond		Euro Bond Absolute Return		European High Yield Bond	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Kanadischer Dollar	-	-	(33.762)	(21.682)	-	-
Tschechische Krone	-	-	(10.856)	-	-	-
Dänische Krone	-	-	1.314.701	995.379	-	-
Euro	10.582.522	9.306.187	32.530.158	34.809.856	349.944.569	29.417.545
Japanischer Yen	-	-	(13.946)	7.513	-	-
Polnischer Zloty	-	-	984.735	-	-	-
Britisches Pfund	(10.199)	(9.957)	379.719	(33.597)	58.629.389	4.651.454
Singapur-Dollar	-	-	-	-	1	(669)
Schweizer Franken	-	-	-	-	60.870	-
US-Dollar	771	(1.488)	(1.123.922)	12.770.407	(218.512)	(1.613.802)
	10.573.094	**9.294.742**	**34.026.827**	**48.527.876**	**408.416.317**	**32.454.528**

	European Sustainable Equity		Event Driven[2]	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	EUR	EUR	US$	US$
Dänische Krone	13.482.154	8.595.903	-	-
Euro	84.856.607	84.020.928	388	-
Norwegische Krone	5.211.792	7.133.296	-	-
Britisches Pfund	24.641.334	24.378.899	4.180.953	901.385
Schwedische Krone	10.498.832	13.773.626	-	-
Schweizer Franken	31.217.338	34.936.391	-	-
US-Dollar	2.189.494	3.015.187	122.230.807	40.545.287
	172.097.551	**175.854.230**	**126.412.148**	**41.446.672**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Global Bond		Global Diversified Income FMP – 2024		Global Equity Megatrends	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Australischer Dollar	1.431.666	(76.731)	-	-	-	-
Brasilianischer Real	17.869	1.366	-	-	-	-
Kanadischer Dollar	3.789.921	12.580.352	-	-	5.599.843	4.945.156
Chilenischer Peso	6.508	6.401	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	290.460	360.970	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	532	(8.276)	-	-	-	-
Kolumbianischer Peso	14.974	(3.588)	-	-	-	-
Tschechische Krone	9.743	(37.717)	-	-	-	-
Dänische Krone	998.642	22.251	-	-	-	-
Euro	26.722.896	21.955.385	92.813	163.266	239.151	8.867
Hongkong-Dollar	20	15.864	333	3.914	-	-
Ungarischer Forint	11.277	15.703	-	-	-	-
Indonesische Rupiah	2.382.231	1.151.870	-	-	-	-
Israelischer Schekel	13.308	(1.874)	-	-	-	-
Japanischer Yen	5.250.782	7.135.466	-	-	-	-
Malaysischer Ringgit	10.350	28.441	-	-	-	-
Mexikanischer Peso	830.191	2.869.583	-	-	-	-
Neuseeländischer Dollar	700.386	1.566.178	-	-	-	-
Norwegische Krone	172.901	(14.416)	-	-	-	-
Peruanischer Sol	2.612	6.187	-	-	-	-
Polnischer Zloty	279.797	33.154	-	-	-	-
Britisches Pfund	5.491.512	6.752.292	89.866	148.036	7.576.753	4.451.862
Rumänischer Leu	2.209	-	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Global Bond (Fortsetzung)		Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)		Global Equity Megatrends (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Singapur-Dollar	8.072	19.850	98.708	208.355	444	-
Südafrikanischer Rand	1.055	4.487	-	-	-	-
Südkoreanischer Won	2.334.784	5.264.565	-	-	-	-
Schwedische Krone	(130.289)	104.449	-	-	-	-
Schweizer Franken	339.669	70.850	-	-	-	-
Thailändischer Baht	23.543	26.583	-	-	-	-
Türkische Lira	-	(95)	-	-	-	-
US-Dollar	57.735.179	74.961.746	155.917.933	159.872.515	131.066.665	69.938.480
	108.742.800	**134.811.296**	**156.199.653**	**160.396.086**	**144.482.856**	**79.344.365**

	Global Flexible Credit Income		Global SDG Engagement		Global High Yield Sustainable Action*	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Australischer Dollar	-	-	1.540	1.177	-	-
Kanadischer Dollar	316.595	78.451	-	-	-	-
Euro	60.909.348	51.658.875	95.970.028	48.374.732	501	3.481.434
Britisches Pfund	17.331.764	34.657.200	17.653.094	7.112.241	221	740.307
Schweizer Franken	-	-	5.650.537	1.822.577	-	-
US-Dollar	312.055.274	308.131.803	438.888.706	279.642.651	(722)	10.825.327
	390.612.981	**394.526.329**	**558.163.905**	**336.953.378**	**-**	**15.047.068**

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Global Investment Grade Credit		Global Opportunistic Bond		Global Real Estate Securities	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Australischer Dollar	-	-	1.180.612	123.667	1.038.540	1.286.976
Brasilianischer Real	-	-	34.023	16.533	-	-
Kanadischer Dollar	1.983.786	2.208.763	(317.187)	(273.916)	827.668	1.815.491
Chilenischer Peso	-	-	2.783	11.491	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	2.096.427	3.467.949	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	-	-	(5.092)	(13)	-	-
Tschechische Krone	-	-	499.862	299.742	-	-
Euro	17.251.644	17.356.141	23.915.436	31.829.021	1.659.999	2.647.086
Hongkong-Dollar	-	-	-	-	956.261	3.067.701
Ungarischer Forint	-	-	279.114	9	-	-
Indonesische Rupiah	-	-	1.596.994	330.337	-	-
Japanischer Yen	-	-	67.899	(92.504)	1.739.044	3.606.589
Mexikanischer Peso	-	-	2.810.772	1.478.309	-	-
Neuseeländischer Dollar	-	-	2.955.614	3.477.029	-	-
Norwegische Krone	-	-	15.024	(43.838)	-	-
Polnischer Zloty	-	-	867.678	271.645	-	-
Britisches Pfund	7.313.323	3.835.303	4.852.959	4.282.014	1.187.032	3.087.877
Russischer Rubel	-	-	1.700	2.082	-	-
Singapur-Dollar	-	-	-	-	734.860	1.500.210
Südafrikanischer Rand	-	-	3.123	18.875	-	-
Südkoreanischer Won	-	-	264.517	(5.485)	-	-
Schwedische Krone	-	-	(360.388)	17.291	-	-
Schweizer Franken	-	-	(235.468)	6.201	304.936	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)		Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)		Global Real Estate Securities (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Thailändischer Baht	-	-	260.293	251.550	-	-
Türkische Lira	-	-	-	(143)	-	-
US-Dollar	60.229.072	62.508.435	24.623.068	30.637.597	12.011.673	22.010.490
	86.777.825	**85.908.642**	**65.409.763**	**76.105.443**	**20.460.013**	**39.022.420**

	Global Sustainable Equity		Global Sustainable Value		High Yield Bond	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Australischer Dollar	-	-	1.682.064	1.196.879	4.335.505	4.321.856
Brasilianischer Real	-	-	572.497	266.033	-	-
Kanadischer Dollar	-	-	2.055.919	1.784.244	128.502	70.793
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	-	-	-	-	33.428	42.580
Dänische Krone	2.356.644	2.087.276	173	259.300	-	-
Euro	18.198.317	13.587.115	4.877.673	4.183.597	5.502.188	12.183.833
Hongkong-Dollar	-	-	1.646.067	1.631.458	982	22.474
Indonesische Rupiah	-	-	192.941	291.610	-	-
Japanischer Yen	2.808.506	1.579.691	3.141.435	2.696.880	-	-
Mexikanischer Peso	-	-	397.431	180.675	-	-
Neuer taiwanesischer Dollar	-	-	1.041.760	796.265	-	-
Neuseeländischer Dollar	-	-	110.971	63.032	-	-
Norwegische Krone	3.833.337	4.295.279	364.322	57.495	-	-
Britisches Pfund	4.551.411	4.182.652	2.682.617	2.197.074	11.900.302	37.568.566
Singapur-Dollar	-	-	245.967	1	1.044.422	1.099.758

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Global Sustainable Equity (Fortsetzung)		Global Sustainable Value (Fortsetzung)		High Yield Bond (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Südafrikanischer Rand	-	-	199.376	370.132	5.521.118	6.026.874
Südkoreanischer Won	-	-	794.977	880.568	-	-
Schwedische Krone	4.357.993	3.754.629	133.988	383.756	4.148.246	320.183
Schweizer Franken	12.094.429	5.969.094	1.191.665	1.186.729	398.057	600.966
US-Dollar	106.372.658	96.122.463	34.134.051	29.598.713	2.218.797.969	2.236.493.829
	154.573.295	**131.578.199**	**55.465.894**	**48.024.441**	**2.251.810.719**	**2.298.751.712**

	InnovAsia 5G		Japan Equity Engagement		Macro Opportunities FX	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	JPY	JPY	EUR	EUR
Australischer Dollar	173.906	-	-	-	39.080	32.782
Brasilianischer Real	-	-	-	-	(4.922)	(82.316)
Kanadischer Dollar	-	2.183.240	-	-	67.179	135.641
Chilenischer Peso	-	-	-	-	5.001	24.906
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	1.007.839	-	-	-	1	5
Tschechische Krone	-	-	-	-	(1.277)	(63.164)
Euro	151.104	302.164	86.682.787	(161.821.291)	2.839.381	32.305.444
Hongkong-Dollar	1	212.641	-	-	-	-
Ungarischer Forint	-	-	-	-	(5.196)	9
Indonesische Rupiah	-	-	-	-	(23)	-
Indische Rupie	2.736.940	539.135	-	-	-	-
Japanischer Yen	6.224.863	3.906.632	16.084.253.643	20.705.605.935	45.896	37.140
Malaysischer Ringgit	481.076	319.895	-	-	-	-
Mexikanischer Peso	-	-	-	-	(8.248)	(85.167)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	InnovAsia 5G (Fortsetzung)		Japan Equity Engagement (Fortsetzung)		Macro Opportunities FX (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	JPY	JPY	EUR	EUR
Neuer taiwanesischer Dollar	5.480.052	3.817.484	-	-	-	-
Neuseeländischer Dollar	-	-	-	-	44.056	303.668
Norwegische Krone	-	-	-	-	(16.499)	34.363
Polnischer Zloty	-	-	-	-	(14.454)	5
Britisches Pfund	-	-	6.592.286	(1.117.058)	46.828	173.711
Singapur-Dollar	591.839	551.007	-	-	-	-
Südafrikanischer Rand	-	-	-	-	(10)	(2.834)
Südkoreanischer Won	3.391.560	515.684	-	-	(4)	(17.087)
Schwedische Krone	-	-	-	-	(10.349)	(594.217)
Schweizer Franken	36.502	26.843	-	-	85.607	64.744
Thailändischer Baht	715.164	-	-	-	-	-
Türkische Lira	-	-	-	-	-	43
US-Dollar	2.230.179	1.980.961	(1)	(1)	(230.241)	(757.520)
Vietnamesischer Dong	549.095	393.307	-	-	-	-
	23.770.120	**14.748.993**	**16.177.528.715**	**20.542.667.585**	**2.881.806**	**31.510.156**

	Multi-Asset Income*		Next Generation Mobility		Next Generation Space Economy[2]	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Australischer Dollar	(3)	46.449	2	2	-	-
Brasilianischer Real	-	18.289	-	-	-	-
Kanadischer Dollar	-	(3.708)	923.624	2.312.662	-	-
Chilenischer Peso	-	1.288	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Multi-Asset Income* (Fortsetzung)		Next Generation Mobility (Fortsetzung)		Next Generation Space Economy[2] (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Chinesischer Yuan Renminbi	-	18.884	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	-	(5.958)	821.040	1.537.306	291.964	103.745
Tschechische Krone	-	(9.292)	-	-	-	-
Euro	-	2.880.701	8.433.497	5.955.204	2.317.039	1.198.609
Hongkong-Dollar	-	99.369	3.492.481	3.880.770	-	-
Ungarischer Forint	-	1	-	-	-	-
Japanischer Yen	-	163.447	3.261.496	2.867.915	1.343.794	172.026
Mexikanischer Peso	-	1.396	-	-	-	-
Neuer taiwanesischer Dollar	-	23.212	1.653.606	1.016.740	190.613	134.550
Neuseeländischer Dollar	-	15.785	-	-	-	-
Norwegische Krone	-	(4.986)	-	-	-	-
Polnischer Zloty	-	1	-	-	-	-
Britisches Pfund	-	302.903	2	2	714.848	334.851
Singapur-Dollar	-	2	1	1	591.275	270.259
Südafrikanischer Rand	-	10.952	-	-	-	-
Südkoreanischer Won	-	31.143	1.389.795	-	1.016.292	288.684
Schwedische Krone	-	4.448	2.040.136	1.854.268	-	-
Schweizer Franken	-	46.820	-	-	-	-
Türkische Lira	-	(15)	-	-	-	-
US-Dollar	3	7.724.984	142.340.385	128.579.807	13.278.105	5.988.138
	-	**11.366.115**	**164.356.065**	**148.004.677**	**19.743.930**	**8.490.862**

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Responsible Asian Debt - Hard Currency		Short Duration Emerging Market Debt		Short Duration High Yield SDG Engagement	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Australischer Dollar	-	-	37.563	18.635	44.496	49.208
Kanadischer Dollar	-	-	8.966	21.567	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	74.865	2.211	34	35	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	(24.478)	37	-	-	5.857	6.127
Euro	2.144.445	650.316	413.407.394	316.112.981	4.239.741	4.043.064
Hongkong-Dollar	-	-	-	-	115	1.251
Indische Rupie	252	-	-	-	-	-
Indonesische Rupiah	7.163	237	-	-	-	-
Japanischer Yen	-	-	22.534.119	20.830.836	5.148.350	11.907.484
Malaysischer Ringgit	14.931	6.219	-	-	-	-
Neuer taiwanesischer Dollar	(1.225)	(9.958)	-	-	-	-
Philippinischer Peso	3.430	-	-	-	-	-
Britisches Pfund	-	-	2.818.335	(13.828.802)	5.454.935	3.863.852
Singapur-Dollar	(561)	1.046	825.980	1.448.291	288.185	92.456
Südafrikanischer Rand	-	-	-	-	397	401
Südkoreanischer Won	131.323	3.527	-	-	-	-
Schwedische Krone	-	-	27.309	(5.841)	-	-
Schweizer Franken	-	-	2.179.655	(1.469.320)	50.323	57.702
Thailändischer Baht	24.924	3.627	-	-	-	-
US-Dollar	61.566.795	20.968.947	3.512.930.212	4.801.533.368	729.202.048	536.352.134
	63.941.864	**21.626.209**	**3.954.769.567**	**5.124.661.750**	**744.434.447**	**556.373.679**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Strategic Income		Sustainable Asia High Yield		Sustainable Emerging Market Corporate Debt	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Australischer Dollar	17.539.127	1.338.717	-	-	-	-
Brasilianischer Real	(207.691)	(401.123)	-	-	-	-
Kanadischer Dollar	(679.684)	427.290	-	-	-	-
Chilenischer Peso	(27.980)	21.849	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	-	-	114.325	152.101
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	4.155.778	-	-	-	(319)	(713)
Kolumbianischer Peso	2.188.592	1.400.056	-	-	-	-
Tschechische Krone	(16.735)	20.373	-	-	-	-
Euro	82.017.440	28.762.204	16.887	241.129	4.228.272	425.989
Hongkong-Dollar	29.305.731	(2.375)	-	-	-	-
Ungarischer Forint	2.681.198	1.858.183	-	-	-	-
Indische Rupie	512		-	-	-	-
Indonesische Rupiah	3.755.309	3.590.638	-	-	-	-
Israelischer Schekel	41	(26.852)	-	-	-	-
Japanischer Yen	5.449.718	21.384.616	-	-	-	-
Malaysischer Ringgit	4.587	11.371	-	-	-	-
Mexikanischer Peso	6.308.818	2.747.959	-	-	988	858
Neuer taiwanesischer Dollar	11.655	4.170	-	-	-	-
Neuseeländischer Dollar	147.133	(59.525)	-	-	-	-
Norwegische Krone	(21.185)	4.975	-	-	-	-
Peruanischer Sol	4.112.101	4.521.028	-	-	-	-
Philippinischer Peso	4.108	-	-	-	-	-
Polnischer Zloty	2.802.855	25.574	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Strategic Income (Fortsetzung)		Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)		Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Britisches Pfund	24.213.364	3.531.816	1.743	13.686	153	(459)
Rumänischer Leu	4.058.739	2.050	-	-	-	-
Singapur-Dollar	2.311.461	1.630.397	-	-	1	1
Südafrikanischer Rand	4.036.991	3.686.731	-	-	-	-
Südkoreanischer Won	15.532	19.745	-	-	-	-
Schwedische Krone	16.635	-	-	-	7.853	(745)
Schweizer Franken	15.397	-	-	-	591.230	198.563
Thailändischer Baht	27.359	2.455	-	-	-	-
Türkische Lira	(30)	1.678.824	-	-	-	-
US-Dollar	1.825.353.588	1.246.624.709	28.546.321	31.667.456	92.846.634	97.468.713
Uruguayischer Peso	23.117	-	-	-	-	-
	2.019.603.581	**1.322.805.855**	**28.564.951**	**31.922.271**	**97.789.137**	**98.244.308**

	Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency[2]		Tactical Marco[1]		Ultra Short Term Euro Bond	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	EUR	EUR
Australischer Dollar	-	-	10.952	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	-	-	(164)	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	-	-	(40.687)	-	-	-
Euro	167.811.670	46.512.189	99.373	-	995.051.895	827.689.558
Japanischer Yen	-	-	(88.203)	-	-	-
Neuseeländischer Dollar	-	-	(27.209)	-	-	-
Norwegische Krone	-	-	4	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency[2] (Fortsetzung)		Tactical Marco[1] (Fortsetzung)		Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	EUR	EUR
Britisches Pfund	-	-	(22.689)	-	(7.923)	(7.637)
Schweizer Franken	-	-	-	-	163.831	(131.943)
US-Dollar	278.080.600	111.908.405	27.230.931	-	(2.335.505)	(6.159.911)
	445.892.270	**158.420.594**	**27.162.308**	**-**	**992.872.298**	**821.390.067**

	Uncorrelated Strategies		Uncorrelated Trading*[2]		US Equity	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Australischer Dollar	(7.146.070)	(15.921.904)	-	(1.220.926)	-	-
Brasilianischer Real	(265.787)	213.635	-	(15.408)	-	-
Kanadischer Dollar	(11.290)	(1.326.573)	(1)	(677.683)	-	-
Chilenischer Peso	14.787	569.854	-	26.136	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi	(980)	6.864.978	-	-	-	-
Chinesischer Yuan Renminbi – Offshore	(148.818)	(41.686.510)	-	58.578	-	-
Kolumbianischer Peso	16.372	(16.602)	-	(1.474)	-	-
Tschechische Krone	2.181.561	2.364.518	-	69	-	-
Dänische Krone	(933.968)	532.153	-	305.817	-	-
Ägyptisches Pfund	247.059	125.217	-	-	-	-
Euro	28.397.963	44.500.025	(213)	72.161.991	-	-
Hongkong-Dollar	(20.735.526)	(29.747.726)	-	(3.019.116)	-	-
Ungarischer Forint	1.255.125	(7.589.014)	-	(16.124)	-	-
Indische Rupie	(182.551)	(390.252)	-	2.039	-	-
Indonesische Rupiah	-	(174.498)	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)		Uncorrelated Trading*2 (Fortsetzung)		US Equity (Fortsetzung)	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Israelischer Schekel	4.184.528	4.743.336	-	-	-	-
Japanischer Yen	6.475.942	22.469.382	-	2.579.962	1.137.567	1.611.150
Malaysischer Ringgit	990	6.589	-	(1.855)	-	-
Mexikanischer Peso	(3.119.203)	(846.328)	-	(1.358)	-	-
Neuer taiwanesischer Dollar	1.950.580	643.394	-	48.871	-	-
Neuseeländischer Dollar	1.315.078	(1.144.140)	-	(40.543)	-	-
Nigerianischer Naira	(523.007)	-	-	-	-	-
Norwegische Krone	(3.335.594)	(461.930)	-	(35.178)	-	-
Philippinischer Peso	25.686	(86.635)	-	-	-	-
Polnischer Zloty	4.549.144	(4.936.105)	-	(329)	-	-
Britisches Pfund	92.344.789	146.277.813	1	(3.452.419)	-	-
Singapur-Dollar	387.816	113.781	-	(1.979)	-	-
Südafrikanischer Rand	12.493.962	984.523	-	(65.216)	-	-
Südkoreanischer Won	8.408.896	21.742.052	-	2.255.903	-	-
Schwedische Krone	(1.353.332)	(2.850.273)	-	41.680	-	-
Schweizer Franken	(7.720.759)	(4.469.935)	1	676.154	-	-
Thailändischer Baht	(56.746)	(3.881)	-	-	-	-
Türkische Lira	(278.695)	114.691	-	3.966	-	-
US-Dollar	1.508.263.469	2.989.873.347	212	642.331.152	48.064.582	29.853.679
	1.626.701.421	**3.130.486.982**	**-**	**711.942.710**	**49.202.149**	**31.464.829**

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	US Equity Index PutWrite		US Large Cap Value		US Long Short Equity	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Euro	341.554	465.872	1.793.476	1.103.186	4.152.987	6.721.254
Britisches Pfund	11.070.085	15.230.653	(348.901)	495.336	59.233	43.281
Singapur-Dollar	9.837	8.116	-	-	4.192	13.246
Schweizer Franken	-	-	-	-	12	11
US-Dollar	717.676.524	664.752.097	1.937.745.803	1.766.355.837	191.253.867	214.752.109
	729.098.000	**680.456.738**	**1.939.190.378**	**1.767.954.359**	**195.470.291**	**221.529.901**

	US Multi Cap Opportunities		US Real Estate Securities		US Small Cap	
	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022	Zum 31. Dezember 2023	Zum 31. Dezember 2022
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
Australischer Dollar	124.577	92.774	726.863	709.236	307.996	136.215
Kanadischer Dollar	-	-	-	-	13.206	12.396
Euro	351.827	504.882	445.574	835.315	387.224	507.870
Hongkong-Dollar	-	-	(119.662)	43.005	-	-
Britisches Pfund	-	-	-	-	28.754	26.178
Singapur-Dollar	649.693	1.012.735	19.673	34.162	-	-
Südafrikanischer Rand	27.054	527.446	764.872	1.021.954	(9.963)	98.794
Schweizer Franken	-	-	97.941	101.404	-	-
US-Dollar	399.338.884	439.178.113	531.174.724	645.280.719	633.124.552	591.597.214
	400.492.035	**441.315.950**	**533.109.985**	**648.025.795**	**633.851.769**	**592.378.667**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(b) Fremdwährungsrisiko (Fortsetzung)

	US Small Cap Intrinsic Value	
	Zum 31. Dezember 2023 US$	Zum 31. Dezember 2022 US$
Japanischer Yen	70.534	-
Britisches Pfund	198.725	207.132
US-Dollar	321.299.358	193.833.908
	321.568.617	194.041.040

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko

Die Portfolios können Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren halten. Jegliche Veränderung des Zinssatzes bestimmter Wertpapiere kann zu fallenden oder steigenden Erträgen führen. Die Kurse der gehaltenen Wertpapiere werden durch inländische Zinssätze beeinflusst. Die Performance des Portfolios wird daher teilweise von der Fähigkeit abhängig sein, solche Zinssatzschwankungen vorwegzunehmen. Die Manager und die Sub-Investment-Manager steuern dieses Risiko anhand von Analysen der Duration und der Renditekurve, um die Durationspositionierung und die Struktur der Renditekurve festzulegen und zu überwachen.

Die Gesellschaft hat im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 53 Portfolios. Bei einundzwanzig der Portfolios waren die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten überwiegend in Dividendenpapieren und nichtverzinslichen Wertpapieren angelegt. Infolgedessen sind diese Portfolios keinen größeren Risiken durch Fluktuationen des herrschenden Marktzinsniveaus ausgesetzt.

Zum Jahresende investierten die unten in der Tabelle aufgeführten Portfolios vor allem in festverzinsliche und variabel verzinsliche Instrumente und sind somit den Auswirkungen der Schwankungen der aktuellen Zinssätze auf ihre jeweilige Finanzposition und die Cashflows ausgesetzt.

Basierend auf der Zusammensetzung der Portfolios zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hätten bei einem Rückgang der Zinssätze um 0,50 % bei gleichzeitiger Konstanz aller anderen Variablen das Nettovermögen und die Veränderungen des Nettovermögens gemäß Gewinn- und Verlustrechnung ungefähr in dem Umfang zugenommen, wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt. Ein Anstieg der Zinssätze um 0,50 % hätte einen entgegengesetzten Effekt in gleicher Höhe gehabt.

Portfolio	Währung	31. Dezember 2023	% des Nettover-mögens	31. Dezember 2022	% des Netto-vermögens
China Bond	CNY	5.023.639	1,09 %	3.911.507	0,86 %
CLO Income	USD	362.300	0,20 %	299.108	0,22 %
Commodities[1]	USD	145.168	0,09 %	60.966	0,07 %
Corporate Hybrid Bond	EUR	24.235.812	1,30 %	25.225.221	1,42 %
Developed Market FMP – 2027[2]	USD	1.697.215	1,23 %	-	-
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	87.547.569	3,30 %	80.254.944	3,22 %
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	33.828.398	2,63 %	37.789.578	2,73 %
Emerging Market Debt Blend	USD	13.406.283	2,54 %	12.264.416	2,61 %
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	2.032.707	3,12 %	1.782.765	3,28 %
Euro Bond	EUR	303.681	2,87 %	236.325	2,54 %
Euro Bond Absolute Return	EUR	457.788	1,35 %	280.039	0,58 %
European High Yield Bond	EUR	5.901.351	1,44 %	547.332	1,69 %
Global Bond	USD	3.523.906	3,24 %	3.834.658	2,84 %
Global Diversified Income FMP – 2024	USD	230.333	0,15 %	902.467	0,56 %
Global Flexible Credit Income	USD	6.035.383	1,55 %	3.518.113	0,89 %
Global SDG Engagement	USD	9.292.202	1,66 %	5.562.582	1,65 %
Global High Yield Sustainable Action*	USD	-	-	276.978	1,84 %
Global Investment Grade Credit	USD	2.583.049	2,98 %	2.526.643	2,94 %
Global Opportunistic Bond	USD	2.389.387	3,65 %	2.504.123	3,29 %
High Yield Bond	USD	37.191.056	1,65 %	43.177.996	1,88 %
Macro Opportunities FX	EUR	4.545	0,16 %	77.127	0,24 %
Multi-Asset Income**	USD	-	-	153.665	1,35 %
Responsible Asian Debt - Hard Currency	USD	1.406.001	2,20 %	457.101	2,11 %
Short Duration Emerging Market Debt	USD	42.766.959	1,08 %	51.673.561	1,01 %
Short Duration High Yield SDG Engagement	USD	8.671.152	1,16 %	6.681.961	1,20 %
Strategic Income	USD	35.814.120	1,77 %	34.630.321	2,62 %
Sustainable Asia High Yield	USD	346.613	1,21 %	407.994	1,28 %
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	1.930.479	1,97 %	2.037.865	2,07 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Portfolio (Fortsetzung)	Währung	31. Dezember 2023	% des Nettover-mögens	31. Dezember 2022	% des Netto-vermögens
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[1]	USD	15.176.781	3,40 %	5.249.224	3,31 %
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	4.724.589	0,48 %	5.435.227	0,66 %
US Equity Index PutWrite	USD	3.184.114	0,44 %	3.224.547	0,47 %
US Long Short Equity	USD	26.847	0,01 %	403.583	0,18 %

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.
** Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.
[1] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.
[2] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

In den nachstehenden Tabellen sind die Zinsrisiken der betreffenden Portfolios zusammengefasst. Sie beinhalten die nicht-derivativen verzinslichen und unverzinslichen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Portfolios zu ihren jeweiligen beizulegenden Zeitwerten, klassifiziert nach Fälligkeitsterminen. Andere Beträge und Verbindlichkeiten unterliegen keinen Veränderungen von Zinssätzen.

China Bond

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr CNY	1 - 5 Jahre CNY	Über 5 Jahre CNY	Unverzinslich CNY	Insgesamt CNY
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	134.244.166	240.367.488	69.958.142	–	444.569.796
Barmittel und Barmitteläquivalente	9.446.611	–	–	–	9.446.611
Vermögenswerte insgesamt	143.690.777	240.367.488	69.958.142	–	454.016.407
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	143.690.777	240.367.488	69.958.142	–	454.016.407

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr CNY	1 - 5 Jahre CNY	Über 5 Jahre CNY	Unverzinslich CNY	Insgesamt CNY
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	139.734.420	234.837.039	50.592.395	–	425.163.854
Barmittel und Barmitteläquivalente	22.788.957	–	–	–	22.788.957
Vermögenswerte insgesamt	162.523.377	234.837.039	50.592.395	–	447.952.811
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	162.523.377	234.837.039	50.592.395	–	447.952.811

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

CLO Income

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	4.994.906	3.895.503	155.791.572	12.221.060	176.903.041
Barmittel und Barmitteläquivalente	12.287.210	–	–	–	12.287.210
Vermögenswerte insgesamt	17.282.116	3.895.503	155.791.572	12.221.060	189.190.251
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	17.282.116	3.895.503	155.791.572	12.221.060	189.190.251

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	–	112.870.953	–	112.870.953
Barmittel und Barmitteläquivalente	20.349.795	–	–	–	20.349.795
Vermögenswerte insgesamt	20.349.795	–	112.870.953	–	133.220.748
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	20.349.795	–	112.870.953	–	133.220.748

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Commodities[1]

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	97.662.888	23.310.069	–	–	120.972.957
Barmittel und Barmitteläquivalente	33.206.631	–	–	–	33.206.631
Vermögenswerte insgesamt	130.869.519	23.310.069	–	–	154.179.588
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	130.869.519	23.310.069	–	–	154.179.588

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	59.358.047	16.849.925	–	–	76.207.972
Barmittel und Barmitteläquivalente	8.094.998	–	–	–	8.094.998
Vermögenswerte insgesamt	67.453.045	16.849.925	–	–	84.302.970
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	67.453.045	16.849.925	–	–	84.302.970

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Corporate Hybrid Bond

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	–	1.743.583.625	10.956.412	1.754.540.037
Barmittel und Barmitteläquivalente	79.423.824	–	–	–	79.423.824
Vermögenswerte insgesamt	79.423.824	–	1.743.583.625	10.956.412	1.833.963.861
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	79.423.824	–	1.743.583.625	10.956.412	1.833.963.861

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	–	1.648.318.515	–	1.648.318.515
Barmittel und Barmitteläquivalente	124.965.163	–	–	–	124.965.163
Vermögenswerte insgesamt	124.965.163	–	1.648.318.515	–	1.773.283.678
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	124.965.163	–	1.648.318.515	–	1.773.283.678

Developed Market FMP – 2027[2]

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	135.777.186	–	–	135.777.186
Barmittel und Barmitteläquivalente	503.437	–	–	–	503.437
Vermögenswerte insgesamt	503.437	135.777.186	–	–	136.280.623
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	503.437	135.777.186	–	–	136.280.623

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Hard Currency

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	69.873.754	338.390.937	2.118.360.675	17.580.000	2.544.205.366
Barmittel und Barmitteläquivalente	2.306.275	–	–	–	2.306.275
Vermögenswerte insgesamt	72.180.029	338.390.937	2.118.360.675	17.580.000	2.546.511.641
Kontenüberziehung	31.716	–	–	–	31.716
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	31.716	–	–	–	31.716
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	72.148.313	338.390.937	2.118.360.675	17.580.000	2.546.479.925

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	60.531.284	259.378.034	1.973.089.093	16.110.000	2.309.108.411
Barmittel und Barmitteläquivalente	107.924.157	–	–	–	107.924.157
Vermögenswerte insgesamt	168.455.441	259.378.034	1.973.089.093	16.110.000	2.417.032.568
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	168.455.441	259.378.034	1.973.089.093	16.110.000	2.417.032.568

Emerging Market Debt – Local Currency

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	44.652.360	409.726.253	745.209.971	16.173.300	1.215.761.884
Barmittel und Barmitteläquivalente	34.899.630	–	–	–	34.899.630
Vermögenswerte insgesamt	79.551.990	409.726.253	745.209.971	16.173.300	1.250.661.514
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	79.551.990	409.726.253	745.209.971	16.173.300	1.250.661.514

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	68.217.227	437.615.624	815.481.065	15.136.550	1.336.450.466
Barmittel und Barmitteläquivalente	12.401.585	–	–	–	12.401.585
Vermögenswerte insgesamt	80.618.812	437.615.624	815.481.065	15.136.550	1.348.852.051
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	80.618.812	437.615.624	815.481.065	15.136.550	1.348.852.051

Emerging Market Debt Blend

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	16.974.932	144.936.438	317.740.980	14.297.035	493.949.385
Barmittel und Barmitteläquivalente	15.095.815	–	–	–	15.095.815
Vermögenswerte insgesamt	32.070.747	144.936.438	317.740.980	14.297.035	509.045.200
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	32.070.747	144.936.438	317.740.980	14.297.035	509.045.200

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	9.270.322	121.904.154	306.840.370	13.380.558	451.395.404
Barmittel und Barmitteläquivalente	4.035.002	–	–	–	4.035.002
Vermögenswerte insgesamt	13.305.324	121.904.154	306.840.370	13.380.558	455.430.406
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	13.305.324	121.904.154	306.840.370	13.380.558	455.430.406

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.497.397	11.238.841	45.591.084	–	58.327.322
Barmittel und Barmitteläquivalente	2.754.078	–	–	–	2.754.078
Vermögenswerte insgesamt	4.251.475	11.238.841	45.591.084	–	61.081.400
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	4.251.475	11.238.841	45.591.084	–	61.081.400

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	517.189	8.561.955	40.718.771	–	49.797.915
Barmittel und Barmitteläquivalente	3.413.071	–	–	–	3.413.071
Vermögenswerte insgesamt	3.930.260	8.561.955	40.718.771	–	53.210.986
Kontenüberziehung	12	–	–	–	12
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	12	–	–	–	12
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	3.930.248	8.561.955	40.718.771	–	53.210.974

Euro Bond

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	463.336	3.556.701	6.153.523	–	10.173.560
Barmittel und Barmitteläquivalente	127.676	–	–	–	127.676
Vermögenswerte insgesamt	591.012	3.556.701	6.153.523	–	10.301.236
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	591.012	3.556.701	6.153.523	–	10.301.236

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Euro Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	65.594	2.688.537	5.792.884	–	8.547.015
Barmittel und Barmitteläquivalente	473.148	–	–	–	473.148
Vermögenswerte insgesamt	538.742	2.688.537	5.792.884	–	9.020.163
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	538.742	2.688.537	5.792.884	–	9.020.163

Euro Bond Absolute Return

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	298.150	9.792.927	23.081.964	–	33.173.041
Barmittel und Barmitteläquivalente	460.317	–	–	–	460.317
Vermögenswerte insgesamt	758.467	9.792.927	23.081.964	–	33.633.358
Kontenüberziehung	412.247	–	–	–	412.247
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	412.247	–	–	–	412.247
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	346.220	9.792.927	23.081.964	–	33.221.111

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	3.933.441	11.682.263	30.292.316	–	45.908.020
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.710.742	–	–	–	1.710.742
Vermögenswerte insgesamt	5.644.183	11.682.263	30.292.316	–	47.618.762
Kontenüberziehung	388	–	–	–	388
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	388	–	–	–	388
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	5.643.795	11.682.263	30.292.316	–	47.618.374

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

European High Yield Bond

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	5.157.916	222.392.136	159.423.752	–	386.973.804
Barmittel und Barmitteläquivalente	16.624.528	–	–	–	16.624.528
Vermögenswerte insgesamt	21.782.444	222.392.136	159.423.752	–	403.598.332
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	21.782.444	222.392.136	159.423.752	–	403.598.332

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	380.405	17.612.967	14.489.268	–	32.482.640
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.372.196	–	–	–	1.372.196
Vermögenswerte insgesamt	1.752.601	17.612.967	14.489.268	–	33.854.836
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	1.752.601	17.612.967	14.489.268	–	33.854.836

Event Driven[1]

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	115.039.719	–	–	–	115.039.719
Barmittel und Barmitteläquivalente	13.500.176	–	–	–	13.500.176
Vermögenswerte insgesamt	128.539.895	–	–	–	128.539.895
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	128.539.895	–	–	–	128.539.895

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Event Driven[1] (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	33.823.354	–	–	–	33.823.354
Barmittel und Barmitteläquivalente	6.873.963	–	–	–	6.873.963
Vermögenswerte insgesamt	40.697.317	–	–	–	40.697.317
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	40.697.317	–	–	–	40.697.317

Global Bond

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.825.203	18.329.072	87.118.370	–	107.272.645
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.162.072	–	–	–	1.162.072
Vermögenswerte insgesamt	2.987.275	18.329.072	87.118.370	–	108.434.717
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	2.987.275	18.329.072	87.118.370	–	108.434.717

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2.208.864	44.832.896	83.833.941	–	130.875.701
Barmittel und Barmitteläquivalente	4.700.090	–	–	–	4.700.090
Vermögenswerte insgesamt	6.908.954	44.832.896	83.833.941	–	135.575.791
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	6.908.954	44.832.896	83.833.941	–	135.575.791

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Global Diversified Income FMP – 2024

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	143.083.313	–	874.554	–	143.957.867
Barmittel und Barmitteläquivalente	11.026.949	–	–	–	11.026.949
Vermögenswerte insgesamt	154.110.262	–	874.554	–	154.984.816
Kontenüberziehung	13	–	–	–	13
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	13	–	–	–	13
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	154.110.249	–	874.554	–	154.984.803

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	23.835.209	128.689.334	1.743.330	–	154.267.873
Barmittel und Barmitteläquivalente	50.248.991	–	–	–	50.248.991
Vermögenswerte insgesamt	74.084.200	128.689.334	1.743.330	–	204.516.864
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	74.084.200	128.689.334	1.743.330	–	204.516.864

Global Flexible Credit Income

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2.915.203	140.275.024	206.687.076	6.088.915	355.966.218
Barmittel und Barmitteläquivalente	25.482.094	–	–	–	25.482.094
Vermögenswerte insgesamt	28.397.297	140.275.024	206.687.076	6.088.915	381.448.312
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	28.397.297	140.275.024	206.687.076	6.088.915	381.448.312

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.261.296	83.431.268	265.368.388	5.585.898	355.646.850
Barmittel und Barmitteläquivalente	10.118.861	–	–	–	10.118.861
Vermögenswerte insgesamt	11.380.157	83.431.268	265.368.388	5.585.898	365.765.711
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	11.380.157	83.431.268	265.368.388	5.585.898	365.765.711

Global SDG Engagement 31.

Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	5.784.900	265.500.629	261.218.885	–	532.504.414
Barmittel und Barmitteläquivalente	10.709.205	–	–	–	10.709.205
Vermögenswerte insgesamt	16.494.105	265.500.629	261.218.885	–	543.213.619
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	16.494.105	265.500.629	261.218.885	–	543.213.619

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	3.726.199	127.664.393	142.628.218	–	274.018.810
Barmittel und Barmitteläquivalente	5.259.514	–	–	–	5.259.514
Vermögenswerte insgesamt	8.985.713	127.664.393	142.628.218	–	279.278.324
Kontenüberziehung	15	–	–	–	15
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	15	–	–	–	15
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	8.985.698	127.664.393	142.628.218	–	279.278.309

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Global High Yield Sustainable Action*

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	106.321	7.096.577	7.336.654	–	14.539.552
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.033.221	–	–	–	1.033.221
Vermögenswerte insgesamt	1.139.542	7.096.577	7.336.654	–	15.572.773
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	1.139.542	7.096.577	7.336.654	–	15.572.773

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.112.393	28.149.954	54.196.428	–	83.458.775
Barmittel und Barmitteläquivalente	3.401.463	–	–	–	3.401.463
Vermögenswerte insgesamt	4.513.856	28.149.954	54.196.428	–	86.860.238
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	4.513.856	28.149.954	54.196.428	–	86.860.238

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	993.712	27.655.463	54.876.198	–	83.525.373
Barmittel und Barmitteläquivalente	3.565.231	–	–	–	3.565.231
Vermögenswerte insgesamt	4.558.943	27.655.463	54.876.198	–	87.090.604
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	4.558.943	27.655.463	54.876.198	–	87.090.604

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Global Opportunistic Bond

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.205.126	8.733.528	54.990.329	21.165	64.950.148
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.529.454	–	–	–	1.529.454
Vermögenswerte insgesamt	2.734.580	8.733.528	54.990.329	21.165	66.479.602
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	2.734.580	8.733.528	54.990.329	21.165	66.479.602

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2.329.048	20.667.995	52.201.854	1.801.216	77.000.113
Barmittel und Barmitteläquivalente	5.863.263	–	–	–	5.863.263
Vermögenswerte insgesamt	8.192.311	20.667.995	52.201.854	1.801.216	82.863.376
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	8.192.311	20.667.995	52.201.854	1.801.216	82.863.376

High Yield Bond

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	11.110.249	925.395.910	1.152.879.000	3.611.285	2.092.996.444
Barmittel und Barmitteläquivalente	73.617.932	–	–	–	73.617.932
Vermögenswerte insgesamt	84.728.181	925.395.910	1.152.879.000	3.611.285	2.166.614.376
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	84.728.181	925.395.910	1.152.879.000	3.611.285	2.166.614.376

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

High Yield Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	772.189.089	1.323.830.144	18.294.706	2.114.313.939
Barmittel und Barmitteläquivalente	134.476.435	–	–	–	134.476.435
Vermögenswerte insgesamt	134.476.435	772.189.089	1.323.830.144	18.294.706	2.248.790.374
Kontenüberziehung	149	–	–	–	149
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	149	–	–	–	149
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	134.476.286	772.189.089	1.323.830.144	18.294.706	2.248.790.225

Macro Opportunities FX

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2.754.542	–	–	–	2.754.542
Barmittel und Barmitteläquivalente	126.875	–	–	–	126.875
Vermögenswerte insgesamt	2.881.417	–	–	–	2.881.417
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	2.881.417	–	–	–	2.881.417

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	32.136.143	–	–	–	32.136.143
Barmittel und Barmitteläquivalente	131.107	–	–	–	131.107
Vermögenswerte insgesamt	32.267.250	–	–	–	32.267.250
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	32.267.250	–	–	–	32.267.250

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Multi-Asset Income*

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	**Bis zu 1 Jahr US$**	**1 - 5 Jahre US$**	**Über 5 Jahre US$**	**Unverzinslich US$**	**Insgesamt US$**
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	944.744	4.255.409	3.815.441	9.015.594
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.795.321	–	–	–	1.795.321
Vermögenswerte insgesamt	1.795.321	944.744	4.255.409	3.815.441	10.810.915
Kontenüberziehung	3.963	–	–	–	3.963
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	3.963	–	–	–	3.963
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	1.791.358	944.744	4.255.409	3.815.441	10.806.952

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Responsible Asian Debt - Hard Currency

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	**Bis zu 1 Jahr US$**	**1 - 5 Jahre US$**	**Über 5 Jahre US$**	**Unverzinslich US$**	**Insgesamt US$**
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	6.946.823	21.342.143	31.925.189	–	60.214.155
Barmittel und Barmitteläquivalente	2.708.868	–	–	–	2.708.868
Vermögenswerte insgesamt	9.655.691	21.342.143	31.925.189	–	62.923.023
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	9.655.691	21.342.143	31.925.189	–	62.923.023

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	**Bis zu 1 Jahr US$**	**1 - 5 Jahre US$**	**Über 5 Jahre US$**	**Unverzinslich US$**	**Insgesamt US$**
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	524.835	6.412.192	13.244.028	–	20.181.055
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.180.261	–	–	–	1.180.261
Vermögenswerte insgesamt	1.705.096	6.412.192	13.244.028	–	21.361.316
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	1.705.096	6.412.192	13.244.028	–	21.361.316

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Short Duration Emerging Market Debt

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	709.354.762	2.565.462.463	493.196.793	49.810.000	3.817.824.018
Barmittel und Barmitteläquivalente	14.257.955	–	–	–	14.257.955
Vermögenswerte insgesamt	723.612.717	2.565.462.463	493.196.793	49.810.000	3.832.081.973
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	723.612.717	2.565.462.463	493.196.793	49.810.000	3.832.081.973

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	650.064.015	3.596.608.250	537.916.711	70.347.000	4.854.935.976
Barmittel und Barmitteläquivalente	196.555.616	–	–	–	196.555.616
Vermögenswerte insgesamt	846.619.631	3.596.608.250	537.916.711	70.347.000	5.051.491.592
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	846.619.631	3.596.608.250	537.916.711	70.347.000	5.051.491.592

Short Duration High Yield SDG Engagement

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	9.930.122	639.212.714	28.290.948	241.028	677.674.812
Barmittel und Barmitteläquivalente	44.469.256	–	–	–	44.469.256
Vermögenswerte insgesamt	54.399.378	639.212.714	28.290.948	241.028	722.144.068
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	54.399.378	639.212.714	28.290.948	241.028	722.144.068

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	23.828.866	460.111.988	28.086.847	1.221.039	513.248.740
Barmittel und Barmitteläquivalente	27.853.758	–	–	–	27.853.758
Vermögenswerte insgesamt	51.682.624	460.111.988	28.086.847	1.221.039	541.102.498
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	51.682.624	460.111.988	28.086.847	1.221.039	541.102.498

Strategic Income

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	222.715.766	226.693.883	1.626.771.226	60.788.966	2.136.969.841
Barmittel und Barmitteläquivalente	55.205.634	–	–	–	55.205.634
Vermögenswerte insgesamt	277.921.400	226.693.883	1.626.771.226	60.788.966	2.192.175.475
Kontenüberziehung	377	–	–	–	377
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	377	–	–	–	377
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	277.921.023	226.693.883	1.626.771.226	60.788.966	2.192.175.098

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	114.007.287	233.727.570	1.015.663.596	58.225.837	1.421.624.290
Barmittel und Barmitteläquivalente	104.978.500	–	–	–	104.978.500
Vermögenswerte insgesamt	218.985.787	233.727.570	1.015.663.596	58.225.837	1.526.602.790
Kontenüberziehung	155	–	–	–	155
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	155	–	–	–	155
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	218.985.632	233.727.570	1.015.663.596	58.225.837	1.526.602.635

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	2.041.966	13.296.029	11.531.216	–	26.869.211
Barmittel und Barmitteläquivalente	1.163.077	–	–	–	1.163.077
Vermögenswerte insgesamt	3.205.043	13.296.029	11.531.216	–	28.032.288
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	3.205.043	13.296.029	11.531.216	–	28.032.288

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	256.500	14.322.223	13.754.217	–	28.332.940
Barmittel und Barmitteläquivalente	2.770.190	–	–	–	2.770.190
Vermögenswerte insgesamt	3.026.690	14.322.223	13.754.217	–	31.103.130
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	3.026.690	14.322.223	13.754.217	–	31.103.130

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.802.010	34.834.285	53.996.504	–	90.632.799
Barmittel und Barmitteläquivalente	3.976.271	–	–	–	3.976.271
Vermögenswerte insgesamt	5.778.281	34.834.285	53.996.504	–	94.609.070
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	5.778.281	34.834.285	53.996.504	–	94.609.070

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	979.077	32.045.482	58.359.521	–	91.384.080
Barmittel und Barmitteläquivalente	6.953.109	–	–	–	6.953.109
Vermögenswerte insgesamt	7.932.186	32.045.482	58.359.521	–	98.337.189
Kontenüberziehung	1.508.656	–	–	–	1.508.656
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	1.508.656	–	–	–	1.508.656
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	6.423.530	32.045.482	58.359.521	–	96.828.533

Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency[1]

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.961.557	28.611.823	385.228.828	–	415.802.208
Barmittel und Barmitteläquivalente	7.042.532	–	–	–	7.042.532
Vermögenswerte insgesamt	9.004.089	28.611.823	385.228.828	–	422.844.740
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	9.004.089	28.611.823	385.228.828	–	422.844.740

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	13.872.499	129.941.857	–	143.814.356
Barmittel und Barmitteläquivalente	8.625.196	–	–	–	8.625.196
Vermögenswerte insgesamt	8.625.196	13.872.499	129.941.857	–	152.439.552
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	8.625.196	13.872.499	129.941.857	–	152.439.552

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Tactical Macro[2]

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	22.994.103	–	–	–	22.994.103
Barmittel und Barmitteläquivalente	3.554.300	–	–	–	3.554.300
Vermögenswerte insgesamt	26.548.403	–	–	–	26.548.403
Kontenüberziehung	68.223	–	–	–	68.223
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	68.223	–	–	–	68.223
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	26.480.180	–	–	–	26.480.180

Ultra Short Term Euro Bond

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	151.715.505	550.851.730	261.634.553	–	964.201.788
Barmittel und Barmitteläquivalente	11.222.572	–	–	–	11.222.572
Vermögenswerte insgesamt	162.938.077	550.851.730	261.634.553	–	975.424.360
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	162.938.077	550.851.730	261.634.553	–	975.424.360

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr EUR	1 - 5 Jahre EUR	Über 5 Jahre EUR	Unverzinslich EUR	Insgesamt EUR
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	47.528.662	511.849.443	239.919.963	–	799.298.068
Barmittel und Barmitteläquivalente	10.039.473	–	–	–	10.039.473
Vermögenswerte insgesamt	57.568.135	511.849.443	239.919.963	–	809.337.541
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	57.568.135	511.849.443	239.919.963	–	809.337.541

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	**Bis zu 1 Jahr US$**	**1 - 5 Jahre US$**	**Über 5 Jahre US$**	**Unverzinslich US$**	**Insgesamt US$**
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	726.121.264	97.774.544	42.920.336	78.510.108	945.326.252
Barmittel und Barmitteläquivalente	215.995.568	–	–	–	215.995.568
Vermögenswerte insgesamt	942.116.832	97.774.544	42.920.336	78.510.108	1.161.321.820
Kontenüberziehung	659	–	–	–	659
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	659	–	–	–	659
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	942.116.173	97.774.544	42.920.336	78.510.108	1.161.321.161

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	**Bis zu 1 Jahr US$**	**1 - 5 Jahre US$**	**Über 5 Jahre US$**	**Unverzinslich US$**	**Insgesamt US$**
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	1.594.362.150	122.919.502	31.139.060	140.344.310	1.888.765.022
Barmittel und Barmitteläquivalente	301.147.318	–	–	–	301.147.318
Vermögenswerte insgesamt	1.895.509.468	122.919.502	31.139.060	140.344.310	2.189.912.340
Kontenüberziehung	22.735	–	–	–	22.735
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	22.735	–	–	–	22.735
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	1.895.486.733	122.919.502	31.139.060	140.344.310	2.189.889.605

Uncorrelated Trading[1]*

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	**Bis zu 1 Jahr US$**	**1 - 5 Jahre US$**	**Über 5 Jahre US$**	**Unverzinslich US$**	**Insgesamt US$**
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	449.200.010	1.270.800	11.950.635	20.035.760	482.457.205
Barmittel und Barmitteläquivalente	66.208.500	–	–	–	66.208.500
Vermögenswerte insgesamt	515.408.510	1.270.800	11.950.635	20.035.760	548.665.705
Kontenüberziehung	27.694	–	–	–	27.694
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	27.694	–	–	–	27.694
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	515.380.816	1.270.800	11.950.635	20.035.760	548.638.011

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

US Equity Index PutWrite

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	344.736.832	318.620.304	–	–	663.357.136
Barmittel und Barmitteläquivalente	56.170.541	–	–	–	56.170.541
Vermögenswerte insgesamt	400.907.373	318.620.304	–	–	719.527.677
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	400.907.373	318.620.304	–	–	719.527.677

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	300.435.106	331.828.970	–	–	632.264.076
Barmittel und Barmitteläquivalente	44.491.927	–	–	–	44.491.927
Vermögenswerte insgesamt	344.927.033	331.828.970	–	–	676.756.003
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	344.927.033	331.828.970	–	–	676.756.003

US Long Short Equity

31. Dezember 2023

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	1.381.526	6.776.840	170.117.450	178.275.816
Barmittel und Barmitteläquivalente	4.926.902	–	–	–	4.926.902
Vermögenswerte insgesamt	4.926.902	1.381.526	6.776.840	170.117.450	183.202.718
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	4.926.902	1.381.526	6.776.840	170.117.450	183.202.718

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(c) Zinsrisiko (Fortsetzung)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Umlaufvermögen	Bis zu 1 Jahr US$	1 - 5 Jahre US$	Über 5 Jahre US$	Unverzinslich US$	Insgesamt US$
Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet	–	2.652.603	5.751.595	159.755.260	168.159.458
Barmittel und Barmitteläquivalente	34.444.171	–	–	–	34.444.171
Vermögenswerte insgesamt	34.444.171	2.652.603	5.751.595	159.755.260	202.603.629
Verbindlichkeiten (ohne das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen)	–	–	–	–	–
Zinssensitivität (aus Inkongruenzen) für das auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallende Nettovermögen	34.444.171	2.652.603	5.751.595	159.755.260	202.603.629

[1] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.
[2] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko

Das Kreditrisiko (oder Ausfallrisiko) ist das Risiko, dass ein Emittent oder eine Gegenpartei einer gegenüber dem Fonds eingegangenen Verbindlichkeit nicht nachkommen kann. Der Fonds hat zum Grundsatz, Finanzinstrumente mit unterschiedlichen, bonitätsmäßig einwandfreien Gegenparteien einzugehen. Deshalb erwartet der Fonds keine wesentlichen Kreditverluste aus seinen Finanzinstrumenten. Der Manager bewertet die Kreditqualität der Gegenparteien, die von dem Fonds genutzt werden. Diese Bewertung beinhaltet mindestens eine anfängliche und eine jährliche Kreditbewertung auf Grundlage der Finanzdaten und/oder Ratings Dritter. Gegenparteien, die für Devisenterminkontrakte und andere außerbörsliche Derivategeschäfte (OTC-Derivate) genutzt werden, unterliegen einer strengeren Überwachung, zu der auch detaillierte Kreditprüfungen mit Ratings Dritter und/oder Faktoren wie Kapitalausstattung, die Qualität der Vermögenswerte, Qualität der Verwaltung, Gewinne und Liquidität gehören. Der Manager verfolgt zudem die Nachrichten aus dem Finanzsektor, um einen Überblick über Trends in Sektoren und Ereignisse zu bekommen, die einen direkten Einfluss auf spezielle Gegenparteien haben können.

Das maximale Kreditrisiko der Gesellschaft (wobei der Wert von gehaltenen Sicherheiten oder anderen Wertpapieren unberücksichtigt bleibt) in dem Fall, dass Gegenparteien ihren Verpflichtungen zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 in Bezug auf jede Klasse erfasster finanzieller Vermögenswerte, mit Ausnahme von Derivaten, nicht nachkommen, ist der Buchwert dieser Vermögenswerte gemäß Angabe in der Bilanz.

Transaktionen im Zusammenhang mit derivativen Finanzinstrumenten werden in der Regel mit Gegenparteien getätigt, mit denen das Portfolio Master Netting Agreements unterzeichnet hat. Master Netting Agreements sehen die Nettoabwicklung von Kontrakten mit derselben Gegenpartei bei einem Ausfall vor. Das mit derivativen finanziellen Vermögenswerten, die einer Master-Netting-Vereinbarung unterliegen, verbundene Kreditrisiko wird nur insoweit eliminiert, als dass gegenüber derselben Gegenpartei fällige finanzielle Verbindlichkeiten abgerechnet werden, nachdem die Vermögenswerte veräußert wurden. Das Risiko wird auch durch Sicherheiten gesteuert, auf die der Fonds bei einem Zahlungsausfall einer Gegenpartei ohne Rückgriff auf diese Gegenpartei sofortigen Zugriff hat.

Kassenbestände, die über in den Büchern von Brown Brothers Harriman & Co. („BBH") geführte Konten gehalten werden, sind Verbindlichkeiten von BBH, während Kassenbestände, die über direkt in den Büchern einer Drittbank als Korrespondenzbank für Kassenbestände, einer Unterdepotbank oder eines Maklers geführte Konten gehalten werden (zusammen die „Vertreterkonten"), Verbindlichkeiten des Vertreters sind. Kassenbestände, die über Vertreterkonten gehalten werden, sind Verbindlichkeiten des Vertreters und begründen ein direktes Schuldner/Gläubiger-Verhältnis zwischen dem Vertreter und dem Fonds. Dementsprechend ist BBH dafür verantwortlich, bei der Verwaltung dieser Vertreterkonten, wenn sie den Vertreter ernannt hat (d. h. im Falle von Korrespondenzbanken für Kassenbestände und Unterdepotbanken), angemessene Sorgfalt walten zu lassen, haftet jedoch nicht für die Rückzahlung, wenn der Vertreter aufgrund eines Konkurses, einer Insolvenz oder aus anderen Gründen die Rückzahlung nicht leistet. Zum 31. Dezember 2023 lagen sämtliche als Tagesgelder gehaltenen Barmittel und Bankguthaben wie in Anmerkung 3 angegeben bei Drittinstituten. Barmittel und Barmitteläquivalente mit einem langfristigen Kreditrating von Investment Grade gemäß Standard & Poor's (31. Dezember 2022: gleich). BBH hat ein langfristiges Kreditrating von A+ (31. Dezember 2022: A+) gemäß Fitch-Rating.

Die Verwahrstelle muss sicherstellen, dass die gesetzliche Trennung der von ihr verwahrten unbaren Vermögenswerte eingehalten wird, dass diese Vermögenswerte auf treuhänderischer Basis gehalten werden und dass geeignete interne Kontrollsysteme vorhanden sind, so dass in den Aufzeichnungen klar die Art und Höhe aller verwahrten Vermögenswerte identifiziert werden. Als Verwahrstelle muss Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited („BBHTS") das Eigentum jedes Vermögenswertes und den Aufbewahrungsort der Eigentumstitel für jeden Vermögenswert sicherstellen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Das zentrale Risiko für den Fonds bleibt das Kreditrisiko, d. h. dass der Manager einen Schuldtitel oder eine Anleihe eines bestimmten Emittenten erwirbt und sie sich nicht erwartungsgemäß entwickelt und entweder Zahlungen ausfallen oder ein erheblicher Rückgang des Sekundärmarktwerts eintritt.

Um dieses Risiko zu mindern, führt der Manager eine unabhängige Due-Diligence-Prüfung jedes Kreditnehmers durch und fokussiert sich auf stabile, leistungsfähige Anleihen mit soliden Erfolgsbilanzen über vorausgegangenen Konjunkturzyklen. Außerdem wird auch die Größe eines Emittenten berücksichtigt. Der Manager favorisiert weiterhin die größeren Emittenten auf dem Markt, die sich über ein Emissionsvolumen von mehr als 500 Mio. US$ definieren. Hinter diesen Emittenten stehen breitere Konsortien, was die Liquidität auf dem Sekundärmarkt steigern kann. Der Manager filtert nicht nur kleinere Emittenten heraus, sondern schließt auch stark zyklische Branchen und Unternehmen mit begrenzter Ertragstransparenz aus seinem Anlageverfahren aus.

Wurde eine bestimmte Anlage getätigt, wird sie vom Manager überwacht. Es wird für jede Anlage fortlaufend ein Spektrum einschlägiger Daten überprüft, insbesondere maßgebliche Finanztreiber, Rohstoffpreise, Aktienkurse, aufsichtsrechtliche Entwicklungen, Finanzergebnisse, Pressemeldungen und Kommentare des Managements, um Hinweise auf eine Verschlechterung der Bonität zu erkennen.

Um dieses Risiko zusätzlich zu steuern, stellen die Direktoren sicher, dass der Manager die von den Direktoren festgelegten Richtlinien zu Anlagelimits und -einschränkungen einhält. Die Direktoren überwachen mit dem Manager auf jeder ihrer Sitzungen die Umsetzung und die Ergebnisse des Anlageverfahrens und sie überwachen ferner die Risikofaktoren für jedes Portfolio.

Bei den Wertpapieren, die BBH in Verwahrung hat, handelt es sich um Aktien, festverzinsliche Wertpapiere, Participatory Notes, ABS-Anleihen und REITs. Alle von BBH (als globale Unterdepotbank für und im Namen von BBHTS und zu Gunsten von deren jeweiligen Kunden) verwahrten Wertpapiere werden von den eigenen Vermögenswerten der BBH getrennt, ungeachtet dessen, ob sie im Tresor von BBH, auf separaten Konten in den Büchern ihrer Unterdepotbanken oder auf einem bei einer Wertpapiersammelbank (Central Securities Depository) geführten Konto gehalten werden. BBH führt für jeden Kunden in ihren Büchern sowie in den Büchern der Unterdepotbank auf dem lokalen Markt, wenn dies möglich ist, separate Konten. Als Verwahrstelle muss BBHTS auch sicherstellen, dass unbare Vermögenswerte auf treuhänderischer Basis über das Netzwerk globaler Unterdepotbanken der BBH gehalten werden.

Die Unterdepotbanken von BBH sind durch Verträge mit BBH und allgemein gemäß dem Gesetz verpflichtet, die Wertpapiere von Depotkunden getrennt vom allgemeinen Bankvermögen der Unterdepotbank zu verwahren.

BBH führt über ihre Network Management Group zu Beginn und danach auf laufender Basis Due-Diligence-Prüfungen bei den Unterdepotbanken in ihrem globalen Verwahrstellennetz durch. Diese Prüfungen beinhalten eine Beurteilung der Service-Standards, des Sachverstandes des Managements, der Marktinformationen, des Verwahrstellenbetriebs, der Berichts- und technologischen Kapazitäten der Unterdepotbank sowie Prüfungen in Bezug auf ihre Reputation und Bonität am Markt und ihr dauerhaftes Engagement im Bereich der Verwahrstellendienstleistungen.

Mit jeder Unterdepotbank werden ein Service Level Agreement sowie die üblichen vertraglichen Vereinbarungen getroffen und diese regelmäßig im Rahmen von Service Review Meetings, einschließlich Due-Diligence-Meetings vor Ort, überprüft.

Die Risk and Credit Group von BBH führt regelmäßig Finanzanalysen bei allen Unterdepotbanken durch und konzentriert sich dabei unter anderem auf die Kapitalausstattung, die Qualität der Vermögenswerte, Gewinne, Liquidität und Kredit-Ratings als wesentliche Kennzahlen. Diese Überprüfungen sind Bestandteil der Routineprüfungen, die BBH im Hinblick auf die finanzielle Stärke und Bonität einer Unterdepotbank vornimmt.

Die Manager überwacht das Risiko für die Gesellschaft gemäß den Richtlinien für OGAW-Fonds und berichtet den Direktoren auf regelmäßiger Basis.

Der Fonds investiert in Schuldtitel, die ein Bonitätsrating einer renommierten Ratingagentur erhalten können. Die Bonitätsratings in den nachstehenden Tabellen werden als Prozentsatz der festverzinslichen Wertpapiere berechnet, wenn ein wesentlicher Anteil des betreffenden Portfolios als festverzinsliche Wertpapiere gehalten wird. Ein Schuldtitel wird als Investment-Grade-Titel betrachtet, wenn er ein Bonitätsrating von BBB- oder höher von Standard & Poor's und von Baa3 oder höher von Moody's hat. Per 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 stellten sich die Engagements nach Bonitätsratings wie folgt dar:

China Bond

Anlagen:		31. Dezember 2023 CNY	31. Dezember 2022 CNY
	Einlagenzertifikate	58.557.000	92.924.345
	Unternehmensanleihen	290.154.114	272.165.839
	Staatsanleihen	95.858.682	60.073.670
Derivate		185.388	1.181.877
Barmittel und Barmitteläquivalente		9.446.611	22.788.957
Forderungen gegenüber Brokern		682.867	839.388

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

China Bond (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	41,43	19,36
	Ohne Investment Grade	5,73	3,71
	Ohne Rating	52,84	76,93
Insgesamt		100,00	100,00

CLO Income

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	159.687.075	112.870.953
	Schatzwechsel	4.994.906	–
Derivate		(176.733)	1.943.252
Barmittel und Barmitteläquivalente		12.287.210	20.349.795
Forderungen gegenüber Brokern		–	320.000

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	3,03	2,44
	Ohne Investment Grade	96,97	97,56
Insgesamt		100,00	100,00

Commodities[2]

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Agency Bonds	–	10.530.836
	Unternehmensanleihen	77.031.796	26.223.262
	Schatzwechsel	43.941.161	39.453.874
Derivate		1.363.262	1.186.450
Barmittel und Barmitteläquivalente		33.206.631	8.094.998
Forderungen gegenüber Brokern		7.330.000	–
Verbindlichkeiten gegenüber Maklern		–	(5.450.000)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	100,00	100,00
Insgesamt		100,00	100,00

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Corporate Hybrid Bond

Anlagen:		31. Dezember 2023 EUR	31. Dezember 2022 EUR
	Unternehmensanleihen	1.743.583.625	1.638.001.345
Derivate		4.369.046	(21.157.336)
Barmittel und Barmitteläquivalente		79.423.824	124.965.163

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	52,83	58,88
	Ohne Investment Grade	47,17	43,54
	Ohne Rating	–	(2,42)
Insgesamt		100,00	100,00

Developed Market FMP – 2027[1]

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$
	Unternehmensanleihen	135.777.186
Derivate		39.476
Barmittel und Barmitteläquivalente		503.437

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %
	Investment Grade	78,86
	Ohne Investment Grade	21,14
Insgesamt		100,00

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Hard Currency

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	732.442.764	784.977.470
	Staatsanleihen	1.794.182.602	1.508.020.941
Derivate		28.532.535	25.569.299
Barmittel und Barmitteläquivalente		2.306.275	107.924.157
Kontenüberziehung		(31.716)	–
Forderungen gegenüber Brokern		22.175.962	3.276.177

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	33,68	36,49
	Ohne Investment Grade	65,67	59,84
	Ohne Rating	0,65	3,67
Insgesamt		100,00	100,00

Emerging Market Debt - Local Currency

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Einlagenzertifikate	–	18.492.177
	Unternehmensanleihen	41.825.600	22.468.723
	Staatsanleihen	1.124.421.834	1.280.353.016
	Schatzwechsel	33.341.150	–
Derivate		933.685	(33.615.251)
Barmittel und Barmitteläquivalente		34.899.630	12.401.585
Forderungen gegenüber Brokern		16.010.321	54.984.796
Verbindlichkeiten gegenüber Maklern		(2.230.000)	(3.980.000)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	83,77	50,41
	Ohne Investment Grade	14,66	16,94
	Ohne Rating	1,57	32,65
Insgesamt		100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	148.077.852	149.902.253
	Staatsanleihen	330.568.106	288.112.593
	Schatzwechsel	1.006.392	–
Derivate		1.629.543	(2.073.158)
Barmittel und Barmitteläquivalente		15.095.815	4.035.002
Forderungen gegenüber Brokern		7.902.696	9.999.389
Verbindlichkeiten gegenüber Maklern		(390.000)	(840.000)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	63,64	46,74
	Ohne Investment Grade	34,73	36,08
	Ohne Rating	1,63	17,18
Insgesamt		100,00	100,00

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	9.239.606	7.512.041
	Staatsanleihen	48.266.565	42.285.874
	Schatzwechsel	821.151	–
Derivate		2.496.697	557.983
Barmittel und Barmitteläquivalente		2.754.078	3.413.071
Kontenüberziehung		–	(12)
Forderungen gegenüber Brokern		679.691	424.677

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	99,70	84,73
	Ohne Investment Grade	–	0,61
	Ohne Rating	0,30	14,66
Insgesamt		100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Euro Bond

Anlagen:		31. Dezember 2023 EUR	31. Dezember 2022 EUR
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	4.100	462.816
	Unternehmensanleihen	4.770.071	4.079.176
	Staatsanleihen	5.399.389	4.005.023
Derivate		(35.197)	(69.064)
Barmittel und Barmitteläquivalente		127.676	473.148
Forderungen gegenüber Brokern		217.984	258.450

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	89,48	68,11
	Ohne Investment Grade	10,52	11,32
	Ohne Rating	–	20,57
Insgesamt		100,00	100,00

Euro Bond Absolute Return

Anlagen:		31. Dezember 2023 EUR	31. Dezember 2022 EUR
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	158.727	2.319.216
	Unternehmensanleihen	18.558.164	23.938.251
	Staatsanleihen	14.456.150	19.650.553
Derivate		(1.402.468)	332.738
Barmittel und Barmitteläquivalente		460.317	1.710.742
Kontenüberziehung		(412.247)	(388)
Forderungen gegenüber Brokern		1.822.858	252.313

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	87,19	66,92
	Ohne Investment Grade	12,81	9,37
	Ohne Rating	–	23,71
Insgesamt		100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

European High Yield Bond

Anlagen:		31. Dezember 2023 EUR	31. Dezember 2022 EUR
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	2.425.341	215.121
	Unternehmensanleihen	384.433.736	32.065.000
	Mittelfristige Schuldverschreibungen	114.727	202.519
Derivate		(620.006)	(1.854.475)
Barmittel und Barmitteläquivalente		16.624.528	1.372.196

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	4,64	7,10
	Ohne Investment Grade	95,36	92,05
	Ohne Rating	–	0,85
Insgesamt		100,00	100,00

Event Driven[2]

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Schatzwechsel	115.039.719	33.823.354
Derivate		4.862.107	917.817
Barmittel und Barmitteläquivalente		13.500.176	6.873.963

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	100,00	100,00
Insgesamt		100,00	100,00

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Global Bond

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Agency Bonds	1.146.538	2.423.190
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	10.864.506	8.861.707
	Unternehmensanleihen	28.855.602	44.359.194
	Staatsanleihen	42.481.574	53.670.009
	Mortgage-Backed Securities	22.645.649	19.062.981
	Kommunalanleihen	1.278.776	1.706.806
	Schatzwechsel	–	791.814
Derivate		12.036	797.126
Barmittel und Barmitteläquivalente		1.162.072	4.700.090
Forderungen gegenüber Brokern		802.148	376.572

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Global Bond (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	75,01	73,77
	Ohne Investment Grade	0,68	–
	Ohne Rating	24,31	26,23
Insgesamt		100,00	100,00

Global Diversified Income FMP – 2024

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	123.463.985	150.336.737
	Staatsanleihen	1.727.993	3.931.136
	Schatzwechsel	18.765.889	–
Derivate		281.732	523.570
Barmittel und Barmitteläquivalente		11.026.949	50.248.991
Kontenüberziehung		(13)	–

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	84,08	62,01
	Ohne Investment Grade	15,92	36,23
	Ohne Rating	–	1,76
Insgesamt		100,00	100,00

Global Flexible Credit Income

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	23.118.219	24.079.041
	Unternehmensanleihen	296.273.462	316.164.124
	Staatsanleihen	15.379.748	9.817.787
	Mittelfristige Schuldverschreibungen	15.105.874	–
Derivate		3.511.941	17.497.471
Barmittel und Barmitteläquivalente		25.482.094	10.118.861
Forderungen gegenüber Brokern		3.225.584	5.284.784
Verbindlichkeiten gegenüber Maklern		(200.000)	–

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	26,71	27,37
	Ohne Investment Grade	72,28	71,41
	Ohne Rating	1,01	1,22
Insgesamt		100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Global SDG Engagement

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	532.499.481	273.005.334
	Mittelfristige Schuldverschreibungen	4.933	1.013.476
Derivate		5.197.440	3.460.687
Barmittel und Barmitteläquivalente		10.709.205	5.259.514
Kontenüberziehung		–	(15)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	2,38	1,24
	Ohne Investment Grade	97,18	98,07
	Ohne Rating	0,44	0,69
Insgesamt		100,00	100,00

Global High Yield Sustainable Action*

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	–	14.443.671
	Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	95.881
Derivate		–	(350.409)
Barmittel und Barmitteläquivalente		52.318	1.033.221

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	–	2,45
	Ohne Investment Grade	–	96,42
	Ohne Rating	–	1,13
Insgesamt		–	100,00

* Der Global High Yield Sustainable Action wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	81.376.321	80.767.363
	Staatsanleihen	2.082.454	2.758.010
Derivate		(1.106.335)	(1.626.695)
Barmittel und Barmitteläquivalente		3.401.463	3.565.231

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	98,32	98,19
	Ohne Investment Grade	1,68	1,36
	Ohne Rating	–	0,45
Insgesamt		100,00	100,00

Global Opportunistic Bond

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Agency Bonds	–	307.820
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	1.817.743	4.290.102
	Unternehmensanleihen	27.412.055	35.431.699
	Staatsanleihen	21.133.383	24.711.043
	Mortgage-Backed Securities	14.565.802	10.458.233
Derivate		(2.049.562)	(2.418.728)
Barmittel und Barmitteläquivalente		1.529.454	5.863.263
Forderungen gegenüber Brokern		1.153.721	1.228.672

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	52,33	44,28
	Ohne Investment Grade	24,77	33,40
	Ohne Rating	22,90	22,32
Insgesamt		100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

High Yield Bond

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	10.897.982	21.830.306
	Unternehmensanleihen	1.999.177.351	1.982.553.426
	Staatsanleihen	36.225.768	–
	Mittelfristige Schuldverschreibungen	43.084.058	91.635.501
Derivate		25.265.889	30.109.875
Barmittel und Barmitteläquivalente		73.617.932	134.476.435
Kontenüberziehung		–	(149)
Forderungen gegenüber Brokern		–	300.000

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	6,90	3,93
	Ohne Investment Grade	92,07	95,03
	Ohne Rating	1,03	1,04
Insgesamt		100,00	100,00

Macro Opportunities FX

Anlagen:		31. Dezember 2023 EUR	31. Dezember 2022 EUR
	Unternehmensanleihen	–	24.967.521
	Staatsanleihen	347.166	2.778.639
	Schatzwechsel	2.407.376	4.389.983
Derivate		13.600	(811.369)
Barmittel und Barmitteläquivalente		126.875	131.107

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	100,00	96,29
	Ohne Rating	–	3,71
Insgesamt		100,00	100,00

Multi-Asset Income*

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Agency Bonds	–	7.644
	Unternehmensanleihen	–	4.880.908
	Staatsanleihen	–	311.601
Derivate		–	(431.372)
Barmittel und Barmitteläquivalente		58.916	1.795.321
Kontenüberziehung		–	(3.963)
Forderungen gegenüber Brokern		–	628.167

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Multi-Asset Income* (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	–	32,33
	Ohne Investment Grade	–	67,52
	Ohne Rating	–	0,15
Insgesamt		–	100,00

* Der Multi-Asset Income wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Responsible Asian Debt - Hard Currency

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	45.692.223	18.090.069
	Staatsanleihen	12.025.196	2.090.986
	Schatzwechsel	2.496.736	–
Derivate		120.024	(6.712)
Barmittel und Barmitteläquivalente		2.708.868	1.180.261
Forderungen gegenüber Brokern		128.088	55.253

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	75,65	70,75
	Ohne Investment Grade	21,04	21,22
	Ohne Rating	3,31	8,03
Insgesamt		100,00	100,00

Short Duration Emerging Market Debt

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	2.406.487.373	3.527.685.607
	Staatsanleihen	1.307.631.941	1.205.827.702
	Schatzwechsel	53.894.704	51.075.667
Derivate		55.420.371	20.870.051
Barmittel und Barmitteläquivalente		14.257.955	196.555.616
Forderungen gegenüber Brokern		5.350.000	–

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	54,66	56,06
	Ohne Investment Grade	43,56	40,46
	Ohne Rating	1,78	3,48
Insgesamt		100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Short Duration High Yield SDG Engagement

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	664.013.737	477.638.711
	Mittelfristige Schuldverschreibungen	13.420.047	23.578.927
	Schatzwechsel	–	10.810.063
Derivate		12.140.835	17.725.693
Barmittel und Barmitteläquivalente		44.469.256	27.853.758

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	3,73	3,70
	Ohne Investment Grade	95,93	96,15
	Ohne Rating	0,34	0,15
Insgesamt		100,00	100,00

Strategic Income

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Agency Bonds	781.434	772.053
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	211.031.917	105.467.359
	Unternehmensanleihen	535.844.310	637.567.177
	Staatsanleihen	175.669.880	243.357.365
	Mortgage-Backed Securities	918.338.562	346.893.475
	Kommunalanleihen	12.918.823	20.744.098
	Mittelfristige Schuldverschreibungen	429.819	579.804
	Schatzwechsel	221.166.130	8.017.122
Derivate		930.018	19.437.605
Barmittel und Barmitteläquivalente		55.205.634	104.978.500
Kontenüberziehung		(377)	(155)
Forderungen gegenüber Brokern		22.631.176	3.722.665
Verbindlichkeiten gegenüber Maklern		(520.000)	(250.000)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	36,88	42,53
	Ohne Investment Grade	16,69	29,92
	Ohne Rating	46,43	27,55
Insgesamt		100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	24.364.117	27.495.016
	Staatsanleihen	2.505.094	837.924
Derivate		(17.944)	266.230
Barmittel und Barmitteläquivalente		1.163.077	2.770.190
Forderungen gegenüber Brokern		108.311	58.035

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	18,00	9,14
	Ohne Investment Grade	76,61	70,09
	Ohne Rating	5,39	20,77
Insgesamt		100,00	100,00

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	83.464.415	86.982.672
	Staatsanleihen	7.168.384	4.401.408
Derivate		1.461.588	761.197
Barmittel und Barmitteläquivalente		3.976.271	6.953.109
Kontenüberziehung		–	(1.508.656)
Forderungen gegenüber Brokern		425.554	166.695

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	51,32	48,27
	Ohne Investment Grade	46,60	46,64
	Ohne Rating	2,08	5,09
Insgesamt		100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	28.120.429	7.708.197
	Staatsanleihen	387.681.779	136.106.159
Derivate		10.665.593	2.895.404
Barmittel und Barmitteläquivalente		7.042.532	8.625.196
Forderungen gegenüber Brokern		4.811.634	199.602

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	37,18	40,50
	Ohne Investment Grade	59,56	59,31
	Ohne Rating	3,26	0,19
Insgesamt		100,00	100,00

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Tactical Macro[1]

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$
	Schatzwechsel	22.994.103
Derivate		173.202
Barmittel und Barmitteläquivalente		3.554.300
Kontenüberziehung		(68.223)
Forderungen gegenüber Brokern		526.958

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %
	Investment Grade	100,00
Insgesamt		100,00

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

Ultra Short Term Euro Bond

Anlagen:		31. Dezember 2023 EUR	31. Dezember 2022 EUR
	Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	90.687.160	72.343.961
	Unternehmensanleihen	789.167.617	670.503.994
	Staatsanleihen	75.386.047	56.450.113
	Schatzwechsel	8.960.964	–
Derivate		(6.740.350)	(925.722)
Barmittel und Barmitteläquivalente		11.222.572	10.039.473
Forderungen gegenüber Brokern		11.144.095	6.612.268

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	91,38	84,47
	Ohne Investment Grade	7,69	12,72
	Ohne Rating	0,93	2,81
Insgesamt		100,00	100,00

Uncorrelated Strategies

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	120.618.827	161.387.060
	Staatsanleihen	38.964.571	4.218.750
	Schatzwechsel	707.195.701	1.582.793.462
Derivate		30.977.706	177.192.829
Barmittel und Barmitteläquivalente		215.995.568	301.147.318
Kontenüberziehung		(659)	(22.735)
Forderungen gegenüber Brokern		456.802.391	737.006.142
Verbindlichkeiten gegenüber Maklern		–	(5.000)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	81,99	90,53
	Ohne Investment Grade	5,87	2,21
	Ohne Rating	12,14	7,26
Insgesamt		100,00	100,00

Uncorrelated Trading[2]*

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	–	13.221.435
	Schatzwechsel	–	449.200.010
Derivate		–	56.910.001
Barmittel und Barmitteläquivalente		198.922	66.208.500
Kontenüberziehung		–	(27.694)
Forderungen gegenüber Brokern		–	89.712.105
Verbindlichkeiten gegenüber Maklern		–	(63.659)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(d) Kredit-/Gegenparteirisiko (Fortsetzung)

Uncorrelated Trading[2]* (Fortsetzung)

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	–	97,14
	Ohne Investment Grade	–	2,58
	Ohne Rating	–	0,28
Insgesamt		–	100,00

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.
* Der Uncorrelated Trading wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

US Equity Index PutWrite

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Staatsanleihen	663.357.136	632.264.076
Derivate		6.338.906	2.309.131
Barmittel und Barmitteläquivalente		56.170.541	44.491.927

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	100,00	100,00
Insgesamt		100,00	100,00

US Long Short Equity

Anlagen:		31. Dezember 2023 US$	31. Dezember 2022 US$
	Unternehmensanleihen	7.670.535	8.400.448
	Mittelfristige Schuldverschreibungen	487.831	–
Derivate		(4.829.968)	8.094.369
Barmittel und Barmitteläquivalente		4.926.902	34.444.171
Forderungen gegenüber Brokern		18.176.471	11.644.215

Kreditratings der Schuldtitel

Portfolio nach Rating		31. Dezember 2023 %	31. Dezember 2022 %
	Investment Grade	87,43	59,83
	Ohne Investment Grade	6,59	28,88
	Ohne Rating	5,98	11,29
Insgesamt		100,00	100,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(e) Liquiditätsrisiko

Die größten Liquiditätsrisiken des Fonds bestehen darin, die Aufträge von Anteilinhabern zur Rücknahme zu erfüllen. Für den Fonds können täglich Barrücknahmen von rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen anfallen. Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile sind auf Verlangen nach Wahl des Inhabers auf Basis des Nettoinventarwerts je Anteil des Portfolio zum Zeitpunkt der Rücknahme zurückzunehmen. Dieses Risiko wird vom Fonds gemildert, indem er vorwiegend in Wertpapiere investiert, die an den anerkannten Märkten in OECD-Mitgliedstaaten und anderen Ländern notiert sind oder gehandelt werden. Dadurch bestehen die Vermögenswerte aus realisierbaren Wertpapieren, die jederzeit verkauft werden können. Des Weiteren begrenzen Sicherheitenvereinbarungen das Ausmaß, in dem Verbindlichkeiten an den Fonds ausgedehnt werden können. Darüber hinaus steht dem Fonds, wie in Anmerkung 19 dargestellt, eine zugesagte Liquiditätsfazilität zur Verfügung.

Finanzielle Verbindlichkeiten

Die Fälligkeitsgruppierung basiert auf der Restlaufzeit ab dem Ende des Berichtszeitraums bis zum vertraglichen Fälligkeitsdatum. Kann die Gegenpartei den Zahlungszeitpunkt auswählen, wird die Verbindlichkeit dem frühestmöglichen Zeitpunkt zugeordnet, zu dem der Fonds zur Zahlung aufgefordert werden kann.

Zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 war die überwiegende Mehrheit der Verbindlichkeiten aller Portfolios innerhalb eines Monats zahlbar. Zu den Fälligkeiten der derivativen finanziellen Verbindlichkeiten sehen Sie bitte die Aufstellung des Wertpapierbestands. Andere Verbindlichkeiten als derivative finanzielle Verbindlichkeiten sind innerhalb eines Monats fällig.

(f) Risiko im Zusammenhang mit dem Austausch des LIBOR

Viele Finanzinstrumente verwenden oder können einen variablen Zins auf Grundlage der London Interbank Offered Rate („LIBOR") verwenden, der Referenzzinssatz, zu dem große internationale Banken ungesicherte Interbankenkredite aufnehmen können. LIBOR ist eventuell ein wesentlicher Faktor bei der Bestimmung der Zahlungsverpflichtungen eines Fonds im Rahmen einer derivativen Anlage, den Finanzierungskosten des Fonds oder eines Wertes oder einer Rendite einer Anlage im Fond und kann eventuell auf eine andere Art und Weise verwendet werden, die die Anlageperformance des Fonds beeinflusst. Die Financial Conduct Authority des Vereinigten Königreichs gab das Auslaufen des LIBORS bekannt. Auch wenn viele LIBOR-Sätze ausliefen, wird bis Juni 2023 weiter eine Auswahl weit genutzter USD-LIBOR-Sätze veröffentlicht, um den Übergang zu erleichtern. Die Portfolios gehen eventuell Engagements in an den LIBOR gebundene Finanzinstrumente ein, um Zahlungsverpflichtungen, Finanzierungsbedingungen, Absicherungsstrategien oder den Anlagewert zu bestimmen. Der Übergang weg vom LIBOR könnte zu einer erhöhten Volatilität und Illiquidität an Märkten für Instrumente führen, deren Bedingungen aktuell den LIBOR enthalten und die Effizienz neuer abgeschlossener Absicherungen mindern.

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen

FRS 102 Section 11.27 zum „Zeitwert: Offenlegung" erfordert die Offenlegung in Bezug auf die Zeitwerthierarchie, in der Zeitwertbewertungen für Aktiva und Passiva kategorisiert sind. Die Offenlegungen basieren auf einer Zeitwerthierarchie mit drei Stufen für die Eingangswerte, die zur Bewertung des Zeitwerts in Bewertungstechniken verwendet werden.

Der Fonds legt der Bewertung nach dem beizulegenden Zeitwert eine Zeitwerthierarchie zu Grunde, die die Bedeutung der zur Bewertung herangezogen Parameter berücksichtigt. Die drei Stufen der Zeitwerthierarchie gemäß FRS 102 werden nachstehend beschrieben:

Stufe 1– Unangepasste, auf aktiven Märkten notierte Preise, die zum Bewertungszeitpunkt für identische, unbeschränkte Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten verfügbar sind.

Stufe 2 – Bewertungsparameter, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit entweder direkt (d. h. als Preise) oder indirekt (d. h. abgeleitet aus Preisen) beobachtbar sind und die nicht der Stufe 1 angehören.

Stufe 3 – Bewertungsparameter für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (d. h. nicht beobachtbare Parameter). Nicht beobachtbare Preisparameter werden bei Anlagen und in Situationen herangezogen, bei denen keine oder nur eine geringe Marktaktivität für das Instrument vorhanden ist. Die zur Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts herangezogenen Parameter erfordern ein hohes Maß an Verwaltung, Beurteilung und Schätzung. Da für diese Wertpapiere keine beobachtbaren Preise verfügbar sind, hätten die Portfolios gegebenenfalls Bewertungstechniken angewandt, um dem beizulegenden Zeitwert zu ermitteln.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Die Stufe in der Zeitwerthierarchie, der die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit zugeordnet wird, wird anhand des niedrigsten Bewertungsparameters festgelegt, der für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit maßgeblich ist. Zu diesem Zweck wird die Maßgeblichkeit eines Parameters anhand der Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit beurteilt. Werden zum Beispiel bei einer Zeitwertbewertung beobachtbare Parameter angewandt, die aufgrund von nicht beobachtbaren Parametern eine maßgebliche Anpassung erfordern, so ist diese Bewertung der Stufe 3 zuzuordnen.

Die Beurteilung der Maßgeblichkeit eines bestimmten Parameters für die Zeitwertbewertung in ihrer Gesamtheit erfordert Urteilsvermögen und die Abwägung von Faktoren, die für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit spezifisch sind.

Die Entscheidung, welche Parameter als beobachtbar gelten, erfordert beträchtliches Urteilsvermögen seitens des Managers. Als beobachtbare Parameter erachtet der Manager Marktdaten, die jederzeit verfügbar sind, auf Markttransaktionen basieren, nicht geschützt sind, regelmäßig veröffentlicht werden, transparent, überprüfbar, verlässlich und konsensgestützt sind und von unabhängigen Quellen bereitgestellt werden, die aktiv an dem betreffenden Markt beteiligt sind.

Der Wert der Anlagen der Portfolios in Aktien, börsengehandelten Indexfonds, Optionsscheinen und ge- und verkauften börsengehandelten Optionen, für die Marktnotierungen zugänglich sind, wird in der Regel durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage des letzten an einer Hauptbörse oder einem Hauptmarkt für dieses Wertpapier notierten Verkaufspreises ermittelt (Parameter der Stufe 1). An der NASDAQ gehandelte Wertpapiere werden normalerweise mit dem offiziellen NASDAQ-Schlusskurs („NOCP") bewertet, der von der NASDAQ an jedem Geschäftstag bereitgestellt wird. Der NOCP ist der zuletzt gemeldete Kurs um 16:00:02 Uhr, Eastern Time, außer wenn dieser Kurs außerhalb der „internen" Geld- und Briefkursspanne (d. h. der Geld- und Briefkurse, die sich die Händler gegenseitig beim Handel für ihre eigenen Konten nennen) liegt. In diesem Fall passt die NASDAQ den Kurs so an, dass er dem internen Geld- oder Briefkurs entspricht, je nachdem, welcher näher liegt. Aufgrund von Verzögerungen bei der Meldung von Transaktionen basiert der NOCP möglicherweise nicht auf dem Preis des letzten Geschäfts vor dem Marktschluss. Wenn es an einem bestimmten Tag keinen Verkauf eines Wertpapiers gibt, können die unabhängigen Pricing-Service-Anbieter das Wertpapier auf der Grundlage von Marktnotierungen bewerten.

Der Wert von Participatory Notes wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden, die auf der zugrunde liegenden Aktien und dem anwendbaren Wechselkurs basieren (Inputfaktoren der Stufe 1).

Der Wert der Anlagen des Portfolios in Schuldtiteln wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage zugänglicher Mittelkurse bestimmt. Falls keine solchen verfügbar sind, werden Methoden genutzt, die verschiedene Überlegungen auf der Grundlage des Wertpapiertyps beinhalten (allgemein Inputfaktoren der Stufe 2). Wenn mehr als eine Marktnotierung für ein Wertpapier verfügbar ist, wird das Wertpapier auf Stufe 2 eingestuft. Neben der Berücksichtigung von Renditen oder Kursen von Wertpapieren vergleichbarer Qualität, des Kupons, der Laufzeit und des Typs, von Hinweisen auf Werte von Händlern und der allgemeinen Marktbedingungen werden im Folgenden weitere Parameter der Stufe 2 und damit verbundene Bewertungstechniken beschrieben, die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern zur Bewertung bestimmter Arten, von den Portfolios gehaltenen Schuldtiteln verwendet werden:

Unternehmensanleihen. Zu den Parametern, die für die Bewertung von Unternehmensanleihen verwendet werden, gehören im Allgemeinen relevante Kreditinformationen, beobachtete Marktbewegungen, sektorrelevante Nachrichten, die Renditekurve der US-Staatsanleihen oder die relevante Benchmark-Renditekurve sowie andere Marktinformationen, zu denen die Renditekurve der Benchmark, gemeldete Transaktionen, Broker-Dealer-Quotierungen, Emittentenspreads, vergleichbare Wertpapiere und Referenzdaten, wie z. B. verfügbar Veröffentlichungen im Bereich der Marktforschung („andere Marktinformationen").

Wandelanleihen. Die zur Bewertung von Wandelanleihen (einschließlich CoCos) herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich Daten zu den zugrunde liegenden Aktien, Wandelprämien, Kurse börsennotierter Anleihen und Vorzugsaktien und andere Marktinformationen. Darunter können gegebenenfalls Benchmarkkurven, Transaktionsausführungsdaten und Sensitivitätsanalysen sein.

US-Staatsanleihen. Die zur Bewertung von US-Staatsanleihen herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich Notierungen verschiedener Inter-Dealer-Broker und andere Marktinformationen.

Quasistaatliche US-Wertpapiere. Die zur Bewertung quasistaatlicher US-Wertpapiere herangezogenen Parameter beinhalten gewöhnlich das Einholen von Benchmark-Notierungen und andere Marktinformationen.

Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS)und hypothekarisch besicherte Wertpapiere (MBS). Zu den Parametern, die für die Bewertung von forderungsbesicherten Wertpapieren und hypothekarisch besicherten Wertpapieren verwendet werden, gehören im Allgemeinen Modelle, die eine Reihe von Faktoren berücksichtigen, darunter: vorzeitige Rückzahlungen, Cashflows, Spreadanpassungen und andere Marktinformationen.

Hochzinstitel. Zu den Parametern, die für die Bewertung von Hochzinstiteln verwendet werden, gehören im Allgemeinen eine Reihe von emittentenbezogenen Beobachtungen von Aktien- und Credit-Default-Swap-Kurven sowie sonstige Marktinformationen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Schwellenländeranleihen und ausländische Staatsanleihen. Zu den Parametern, die für die Bewertung von Schuldtiteln aus Schwellenländern und ausländischen Staatspapieren verwendet werden, gehören im Allgemeinen Händlernotierungen, Anleihemarktaktivitäten, diskontierte Cashflow-Modelle und andere relevante Informationen wie Kreditspreads, Benchmarkkurven und andere Marktinformationen.

Besicherte Schuldtitel (Collateralized Loan Obligations, CLOs). Der Wert besicherter Schuldtiteln wird vorrangig durch Cashflow-Daten, relevante Daten zur Preisgestaltung von Darlehen und Marktfarben (Informationen, die für ein Unternehmen, eine Branche oder einen Markt spezifischer sind als öffentliche Informationen) sowie durch das Research von Marktteilnehmern und Trading Desks bestimmt (Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3).

Der Wert von Laufzeitkrediten wird in erster Linie durch Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage von Broker-Quotierungen ermittelt (im Allgemeinen Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3, je nach Anzahl der verfügbaren Quotierungen).

Der Wert von Futures-Kontrakten wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern zum Abrechnungskurs bei Börsenschluss eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 1).

Der Wert von Devisenterminkontrakten wird bestimmt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden, die auf tatsächlich gehandelten Währungskursen in den Netzwerken dieser unabhängigen Dienste sowie auf anderen gehandelten und notierten Währungskursen basieren, die den Pricing-Service-Anbietern von führenden Marktteilnehmern zur Verfügung gestellt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Credit Default Swaps wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern eingeholt werden. Dabei kommt ein Modell zum Einsatz, das eine Reihe von Faktoren berücksichtigt, darunter möglicherweise Ausfallwahrscheinlichkeiten, Kreditkurven, Wiedereinbringungsquoten und Cashflows (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Inflationswaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter unter Bezugnahme auf die zugrunde liegenden Inflationsraten einschließlich der prognostizierten erwarteten Inflationsrate und der jeweiligen Interbank Offered Forward Rate für den Tagessatz ermittelt. Der Barwert wird anhand der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Inflationserwartungskurve und den Referenzsatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Zinsswaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbietern auf der Grundlage von Referenzen zu den zugrunde liegenden Sätzen einschließlich des lokalen OIS (Overnight Index Swap) und des jeweiligen IBOR (Interbank Offered Forward) für den Tagessatz ermittelt. Der Barwert wird anhand der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Zinskurve und den Referenzzinssatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Total Return Swaps wird bestimmt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern unter Verwendung des zugrunde liegenden Vermögenswerts und des angegebenen Zinssatzes der Benchmark eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Cross-Currency-Swaps wird durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter anhand des Barwerts der erwarteten Cashflows auf Basis der Swap-Parameter sowie unter Bezugnahme auf die zugrunde liegende Zinskurve und den Referenzzinssatz berechnet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Volatility-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf einem vorab festgestellten Volatilitätsniveau gegenüber der tatsächlichen, über einen gewissen Zeitraum realisierten Volatilität auf Grundlage von Daten des Referenzwerts (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Variance-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf der in der Vergangenheit realisierten und der voraussichtlichen künftigen Varianz (oder fairen Varianz) des Referenzwerts (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Correlation-Swaps wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern ermittelt und basiert auf der Differenzen zwischen der realisierten Korrelation und einem festen Korrelationswert (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Wert von Differenzkontrakten („CFD") wird in erster Linie durch die Einholung von Bewertungen unabhängiger Pricing-Service-Anbieter ermittelt, die auf der Bezugnahme auf den zugrunde liegenden Vermögenswert sowie den angegebenen Referenzzinssatz beruhen (Inputfaktoren der Stufe 2).Der Wert von Swaptions wird ermittelt, indem Bewertungen von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern oder von Gegenparteien zum Abrechnungskurs bei Börsenschluss eingeholt werden (Inputfaktoren der Stufe 2).

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Optionskontrakte, die im Freiverkehr gehandelt werden, werden generell auf der Grundlage von Notierungen bewertet, die von Broker-Dealern gestellt werden, oder von Preisen, die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern bereitgestellt werden, welche eine Reihe von Methoden einsetzen, unter anderem simulierte Preismodelle und/oder Kurvenanpassung (Bootstrapping), was die Ermittlung des Barwerts der Kontrakte erleichtert. Die Preismodelle ziehen Parameter heran, die auf aktiv notierten Märkten beobachtet werden, wie Angaben zum Emittenten, Indizes, Spreads, Zinssätze, Renditekurven, Volatilitätsoberflächen und Wechselkurse (Inputfaktoren der Stufe 2).

Einlagenzertifikate werden zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet (Parameter der Stufe 2).

Umgekehrte Pensionsgeschäfte werden von Pricing-Service-Anbietern zum Nennwert bewertet (Inputfaktoren der Stufe 2).

Der Manager hat einen Prozess entwickelt, um die von unabhängigen Pricing-Service-Anbietern bereitgestellten Informationen für alle Arten von Wertpapieren regelmäßig zu überprüfen.

Anlagen in nicht börsengehandelte Investmentgesellschaften werden anhand des täglich berechneten Nettoinventarwerts („NIW") pro Anteil des jeweiligen Fonds bewertet (Inputfaktoren der Stufe 2), sofern verfügbar.

Wenn keine Bewertung von einem unabhängigen Pricing-Service-Anbieter verfügbar ist oder wenn der Manager Grund zu der Annahme hat, dass die erhaltene Bewertung nicht dem Betrag entspricht, den ein Portfolio bei einem aktuellen Verkauf in einer ordnungsgemäßen Transaktion vernünftigerweise erwarten könnte, versucht der Manager, Quotierungen von Brokern oder Händlern einzuholen (sie werden im Allgemeinen je nach der Anzahl der verfügbaren Angebote als Inputfaktoren der Stufe 2 oder der Stufe 3 erachtet). Wenn solche Quotierungen nicht verfügbar sind, wird das Wertpapier anhand von Methoden bewertet, welche die Direktoren in dem guten Glauben genehmigt haben, dass die resultierende Bewertung den beizulegenden Zeitwert des Wertpapiers widerspiegelt.

Parameter und Annahmen, die bei der Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts eines Wertpapiers auf der Grundlage von Inputfaktoren der Stufe 2 oder 3 berücksichtigt werden, gehören unter anderem die Art des Wertpapiers, die Anschaffungskosten des Wertpapiers, das Vorhandensein vertraglicher Beschränkungen für die Veräußerung des Wertpapiers, der Preis und der Umfang des öffentlichen Handels mit ähnlichen Wertpapieren des Emittenten oder vergleichbarer Unternehmen; Notierungen oder bewertete Preise von Broker-Dealern und/oder Pricing-Service-Anbietern; Informationen, die vom Emittenten und/oder von Analysten eingeholt wurden; eine Analyse der Abschlüsse des Unternehmens oder des Emittenten; eine Bewertung der Parameter, die den Emittenten beeinflussen, und des Marktes/der Märkte, auf dem/denen das Wertpapier gekauft und verkauft wird.

Der Wert der Anlagen der Portfolios in ausländischen Wertpapieren wird in der Regel mit denselben Bewertungsmethoden und Parametern wie bei anderen Portfolioanlagen und wie oben beschrieben bestimmt. Die in Landeswährung ausgedrückten Preise ausländischer Wertpapiere werden normalerweise von der Landeswährung in US-Dollar umgerechnet. Dabei werden die Wechselkurse um 16:00 Uhr Eastern Time an Tagen verwendet, an denen die New York Stock Exchange („NYSE") für den Geschäftsverkehr geöffnet ist. Die Direktoren haben die Inanspruchnahme der Interactive Data Pricing & Reference Data LLC („ICE") genehmigt, um bei der Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts ausländischer Dividendenpapiere mitzuwirken, wenn Änderungen im Wert eines bestimmten Index andeuten, dass die Schlusskurse an den ausländischen Börsen ggf. nicht länger repräsentativ für den Preis sind, den ein Portfolio für diese Wertpapiere oder an Tagen erwarten könnte, wenn ausländische Märkte geschlossen und US-Märkte offen sind. In jedem dieser Fälle liefert ICE mittels einer statistischen Analyse historischer Korrelationen mehrerer Faktoren angepasste Kurse für bestimmte ausländische Dividendenpapiere (Inputfaktoren der Stufe 2). Die Direktoren haben zudem die Verwendung von ICE genehmigt, um die Preise ausländischer Schuldtiteln zu dem Zeitpunkt zu bewerten, zu dem der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird. ICE verwendet Benchmark-Spread- und Renditekurven und wertet die verfügbaren Marktaktivitäten vom lokalen Börsenschluss bis zu dem Zeitpunkt aus, zu dem der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird (Inputfaktoren der Stufe 2), um so bei der Ermittlung der Preise bestimmter ausländischer Schuldtitel zu helfen.

Sowohl bei ausländischen Aktien als auch bei ausländischen Schuldtiteln haben die Direktoren Mangels genauer Informationen über die Marktwerte dieser ausländischen Wertpapiere zu dem Zeitpunkt, wenn der Anteilspreis eines Portfolios berechnet wird anhand verfügbarer Daten entschieden, dass auf diese Art und Weise angepasste oder geschätzte Preise wahrscheinlich eher den Preisen entsprechen, die ein Portfolio bei einem aktuellen Verkauf erzielen könnte, als die Preise derjenigen Wertpapiere, die bei Börsenschluss der ausländischen Märkte ermittelt werden, auf denen die Wertpapiere vorwiegend gehandelt werden.

Preise zum beizulegenden Zeitwert sind notwendigerweise Schätzungen. Es gibt keine Gewähr, dass ein solcher Preis dem tatsächlichen Preis, zu dem das Wertpapier als nächstes notiert oder gehandelt wird, entspricht oder diesem nahe kommt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Die nachstehenden Tabellen zeigen Finanzanlagen nach den Stufen in der Zeitwerthierarchie:

5G Connectivity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	963.698.691	26.816.617	–	990.515.308
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	6.342.222	–	6.342.222
Vermögenswerte insgesamt	**963.698.691**	**33.158.839**	**–**	**996.857.530**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.033.321)	–	(1.033.321)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(1.033.321)**	**–**	**(1.033.321)**

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	33.229.577	(33.229.577)	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	884.202.753	68.691.966	–	952.894.719
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	12.141.765	–	12.141.765
Vermögenswerte insgesamt	**884.202.753**	**80.833.731**	**–**	**965.036.484**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(3.280.059)	–	(3.280.059)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(3.280.059)**	**–**	**(3.280.059)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Absolute Return Multi Strategy*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3** US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	–	–	6.311	6.311
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**–**	**6.311**	**6.311**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3** US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	–	–	6.766	6.766
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**–**	**6.766**	**6.766**

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.
** Aktien der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

China A-Share Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	13.480.937	–	–	13.480.937
Vermögenswerte insgesamt	**13.480.937**	**–**	**–**	**13.480.937**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	15.264.413	53.280	–	15.317.693
Vermögenswerte insgesamt	**15.264.413**	**53.280**	**–**	**15.317.693**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

China Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Einlagenzertifikat	–	58.557.000	–	58.557.000
Unternehmensanleihen	–	290.154.114	–	290.154.114
Staatsanleihen	–	95.858.682	–	95.858.682
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.943.751	–	1.943.751
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	603.582	–	–	603.582
Vermögenswerte insgesamt	**603.582**	**446.513.547**	**–**	**447.117.129**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(2.361.945)	–	(2.361.945)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(2.361.945)**	**–**	**(2.361.945)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	272.165.839	–	272.165.839
Einlagenzertifikate	–	92.924.345	–	92.924.345
Staatsanleihen	–	60.073.670	–	60.073.670
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	3.921.557	–	3.921.557
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**429.085.411**	**–**	**429.085.411**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 CNY	Stufe 2 CNY	Stufe 3 CNY	Insgesamt CNY
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(2.701.843)	–	(2.701.843)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(37.837)	–	–	(37.837)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(37.837)**	**(2.701.843)**	**–**	**(2.739.680)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

China Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	171.916.351	–	–	171.916.351
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	547.220	–	547.220
Vermögenswerte insgesamt	**171.916.351**	**547.220**	**–**	**172.463.571**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(423.344)	–	(423.344)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(423.344)**	**–**	**(423.344)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	306.849.688	–	–	306.849.688
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.099.861	–	1.099.861
Vermögenswerte insgesamt	**306.849.688**	**1.099.861**	**–**	**307.949.549**

Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(817.712)	–	(817.712)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(817.712)**	**–**	**(817.712)**

Climate Innovation[1]

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	2.603.137	228.261	–	2.831.398
Vermögenswerte insgesamt	**2.603.137**	**228.261**	**–**	**2.831.398**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

CLO Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	4.994.906	–	4.994.906
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	159.687.075	–	159.687.075
Investmentfonds	12.221.060	–	–	12.221.060
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.345.289	–	2.345.289
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	48.732	–	48.732
Vermögenswerte insgesamt	**12.221.060**	**167.076.002**	**–**	**179.297.062**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(2.570.754)	–	(2.570.754)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(2.570.754)**	**–**	**(2.570.754)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	112.870.953	–	112.870.953
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	3.267.421	–	3.267.421
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**116.138.374**	**–**	**116.138.374**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(989.846)	–	(989.846)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(334.323)	–	(334.323)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(1.324.169)**	**–**	**(1.324.169)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Commodities[2]

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	43.941.161	–	43.941.161
Unternehmensanleihen	–	77.031.796	–	77.031.796
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.573.388	–	1.573.388
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	0	–	0
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**122.546.345**	**–**	**122.546.345**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(210.126)	–	(210.126)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(0)	–	(0)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(210.126)**	**–**	**(210.126)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	10.530.836	–	10.530.836
Unternehmensanleihen	–	26.223.262	–	26.223.262
Schatzwechsel	–	39.453.874	–	39.453.874
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.519.496	–	1.519.496
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	0	–	0
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**77.727.468**	**–**	**77.727.468**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(333.046)	–	(333.046)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(333.046)**	**–**	**(333.046)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Corporate Hybrid Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	1.743.583.625	–	1.743.583.625
Investmentfonds	–	10.956.412	–	10.956.412
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	12.101.176	–	12.101.176
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**1.766.641.213**	**–**	**1.766.641.213**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(7.732.130)	–	(7.732.130)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(7.732.130)**	**–**	**(7.732.130)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	1.638.001.345	–	1.638.001.345
Investmentfonds	–	10.317.170	–	10.317.170
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	36.511.573	–	36.511.573
Vermögenswerte insgesamt	–	1.684.830.088	–	1.684.830.088

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	–	(37.445.575)	–	(37.445.575)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(20.223.334)	–	(20.223.334)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(57.668.909)**	**–**	**(57.668.909)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Developed Market FMP – 2027[1]

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	135.777.186	–	135.777.186
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	39.869	–	39.869
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**135.817.055**	**–**	**135.817.055**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(393)	–	(393)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(393)**	**–**	**(393)**

Emerging Market Debt - Hard Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	732.442.764	–	732.442.764
Staatsanleihen	–	1.794.182.602	–	1.794.182.602
Investmentfonds	–	17.580.000	–	17.580.000
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	24.839.124	–	24.839.124
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	19.568.314	–	–	19.568.314
Vermögenswerte insgesamt	**19.568.314**	**2.569.044.490**	**–**	**2.588.612.804**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(5.652.118)	–	(5.652.118)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(10.222.785)	–	–	(10.222.785)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(10.222.785)**	**(5.652.118)**	**–**	**(15.874.903)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	784.977.470	–	784.977.470
Staatsanleihen	–	1.508.020.941	–	1.508.020.941
Investmentfonds	–	16.110.000	–	16.110.000
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	12.379.899	–	12.379.899
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	23.148.647	–	–	23.148.647
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	1.909.636	–	1.909.636
Vermögenswerte insgesamt	**23.148.647**	**2.323.397.946**	**–**	**2.346.546.593**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(10.560.096)	–	(10.560.096)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(1.308.787)	–	–	(1.308.787)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(1.308.787)**	**(10.560.096)**	**–**	**(11.868.883)**

Emerging Market Debt - Local Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	33.341.150	–	33.341.150
Unternehmensanleihen	–	41.825.600	–	41.825.600
Staatsanleihen	–	1.124.421.834	–	1.124.421.834
Investmentfonds	–	16.173.300	–	16.173.300
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	17.116.276	–	17.116.276
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	313.668	–	–	313.668
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	11.479.756	–	11.479.756
Vermögenswerte insgesamt	**313.668**	**1.244.357.916**	**–**	**1.244.671.584**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(12.281.584)	–	(12.281.584)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(716.676)	–	–	(716.676)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(14.977.755)	–	(14.977.755)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(716.676)**	**(27.259.339)**	**–**	**(27.976.015)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Einlagenzertifikat	–	18.492.177	–	18.492.177
Unternehmensanleihen	–	22.468.723	–	22.468.723
Staatsanleihen	–	1.280.353.016	–	1.280.353.016
Investmentfonds	–	15.136.550	–	15.136.550
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	14.987.459	–	14.987.459
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	8.845.584	–	8.845.584
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**1.360.283.509**	**–**	**1.360.283.509**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(9.665.447)	–	(9.665.447)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(676.393)	–	–	(676.393)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(47.106.454)	–	(47.106.454)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(676.393)**	**(56.771.901)**	**–**	**(57.448.294)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	1.006.392	–	1.006.392
Unternehmensanleihen	–	148.077.852	–	148.077.852
Staatsanleihen	–	330.568.106	–	330.568.106
Investmentfonds	–	14.297.035	–	14.297.035
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	6.637.946	–	6.637.946
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	1.199.361	–	–	1.199.361
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	2.641.912	–	2.641.912
Vermögenswerte insgesamt	**1.199.361**	**503.229.243**	**–**	**504.428.604**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(2.075.226)	–	(2.075.226)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(969.525)	–	–	(969.525)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(5.804.925)	–	(5.804.925)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(969.525)**	**(7.880.151)**	**–**	**(8.849.676)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	149.902.253	–	149.902.253
Staatsanleihen	–	288.112.593	–	288.112.593
Investmentfonds	–	13.380.558	–	13.380.558
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	4.031.358	–	4.031.358
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	1.175.800	–	–	1.175.800
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	1.658.685	–	1.658.685
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	4.841.085	–	4.841.085
Vermögenswerte insgesamt	**1.175.800**	**461.926.532**	**–**	**463.102.332**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(2.058.976)	–	(2.058.976)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(159.705)	–	–	(159.705)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(11.561.405)	–	(11.561.405)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(159.705)**	**(13.620.381)**	**–**	**(13.780.086)**

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	821.151	–	821.151
Unternehmensanleihen	–	9.239.606	–	9.239.606
Staatsanleihen	–	48.266.565	–	48.266.565
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.325.031	–	2.325.031
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	832.110	–	–	832.110
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	19.138	–	19.138
Vermögenswerte insgesamt	**832.110**	**60.671.491**	**–**	**61.503.601**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(284.238)	–	(284.238)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(356.901)	–	–	(356.901)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(38.443)	–	(38.443)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(356.901)**	**(322.681)**	**–**	**(679.582)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	7.512.041	–	7.512.041
Staatsanleihen	–	42.285.874	–	42.285.874
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	446.879	–	446.879
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	610.127	–	–	610.127
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	43.385	–	43.385
Vermögenswerte insgesamt	**610.127**	**50.288.179**	**–**	**50.898.306**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(340.697)	–	(340.697)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(65.989)	–	–	(65.989)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(135.722)	–	(135.722)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(65.989)**	**(476.419)**	**–**	**(542.408)**

Emerging Markets Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	67.541.404	19.761.296	–	87.302.700
Immobilienaktiengesellschaften	481.105	–	–	481.105
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.272.409	–	1.272.409
Vermögenswerte insgesamt	**68.022.509**	**21.033.705**	**–**	**89.056.214**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(787.152)	–	(787.152)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(787.152)**	**–**	**(787.152)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	2.701.849	(2.701.849)	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	139.636.822	49.097.184	–	188.734.006
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.053.813	–	1.053.813
Vermögenswerte insgesamt	**139.636.822**	**50.150.997**	**–**	**189.787.819**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(666.859)	–	(666.859)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(666.859)**	**–**	**(666.859)**

Emerging Markets Select Equity*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	67.247.423	23.179.556	–	90.426.979
Insgesamt	**67.247.423**	**23.179.556**	**–**	**90.426.979**

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Euro Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	4.100	–	4.100
Unternehmensanleihen	–	4.770.071	–	4.770.071
Staatsanleihen	–	5.399.389	–	5.399.389
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	32.300	–	–	32.300
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	6.642	–	6.642
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	7.001	–	7.001
Vermögenswerte insgesamt	**32.300**	**10.187.203**	**–**	**10.219.503**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(19.007)	–	–	(19.007)
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	(3.665)	–	(3.665)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(3.982)	–	(3.982)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(54.486)	–	(54.486)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(19.007)**	**(62.133)**	**–**	**(81.140)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	462.816	–	462.816
Unternehmensanleihen	–	4.079.176	–	4.079.176
Staatsanleihen	–	4.005.023	–	4.005.023
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	93	–	93
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	41.432	–	–	41.432
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	1.858	–	1.858
Vermögenswerte insgesamt	**41.432**	**8.548.966**	**–**	**8.590.398**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Euro Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(82.010)	–	–	(82.010)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(6.528)	–	(6.528)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(23.909)	–	(23.909)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(82.010)**	**(30.437)**	**–**	**(112.447)**

Euro Bond Absolute Return

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	158.727	–	158.727
Unternehmensanleihen	–	18.558.164	–	18.558.164
Staatsanleihen	–	14.456.150	–	14.456.150
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	25.383	–	25.383
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	47.035	–	–	47.035
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	26.569	–	26.569
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	113.881	–	113.881
Vermögenswerte insgesamt	**47.035**	**33.338.874**	**–**	**33.385.909**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.117.757)	–	(1.117.757)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(301.831)	–	–	(301.831)
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	(14.661)	–	(14.661)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(181.087)	–	(181.087)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(301.831)**	**(1.313.505)**	**–**	**(1.615.336)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	2.319.216	–	2.319.216
Unternehmensanleihen	–	23.938.251	–	23.938.251
Staatsanleihen	–	19.650.553	–	19.650.553
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	61.989	–	61.989
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	39.745	–	39.745
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	1.497.736	–	–	1.497.736
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	12.884	–	12.884
Vermögenswerte insgesamt	**1.497.736**	**46.022.638**	**–**	**47.520.374**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	(67.569)	–	(67.569)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.032.074)	–	(1.032.074)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(103.516)	–	–	(103.516)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(32.637)	–	(32.637)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(43.820)	–	(43.820)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(103.516)**	**(1.176.100)**	**–**	**(1.279.616)**

European High Yield Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	2.425.341	–	2.425.341
Unternehmensanleihen	–	384.433.736	–	384.433.736
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	114.727	–	114.727
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	643.091	–	643.091
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	18.355	–	18.355
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**387.635.250**	**–**	**387.635.250**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.281.452)	–	(1.281.452)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(1.281.452)**	**–**	**(1.281.452)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	215.121	–	215.121
Unternehmensanleihen	–	32.065.000	–	32.065.000
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	202.519	–	202.519
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.258.544	–	1.258.544
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**33.741.184**	**–**	**33.741.184**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(3.113.019)	–	(3.113.019)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(3.113.019)**	**–**	**(3.113.019)**

European Sustainable Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	171.225.790	–	–	171.225.790
Vermögenswerte insgesamt	**171.225.790**	**–**	**–**	**171.225.790**

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	111.860.905	(111.860.905)	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	40.367.498	134.021.329	–	174.388.827
Vermögenswerte insgesamt	**40.367.498**	**134.021.329**	**–**	**174.388.827**

Event Driven[2]

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	115.039.719	–	115.039.719
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	4.057.943	–	4.057.943
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	959.529	–	959.529
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**120.057.191**	**–**	**120.057.191**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(155.365)	–	(155.365)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(155.365)**	**–**	**(155.365)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	33.823.354	–	33.823.354
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	918.069	–	918.069
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	18.364	–	18.364
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**34.759.787**	**–**	**34.759.787**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Event Driven[2] (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(18.616)	–	(18.616)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(18.616)**	**–**	**(18.616)**

Global Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	1.146.538	–	1.146.538
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	10.864.506	–	10.864.506
Unternehmensanleihen	–	28.855.602	–	28.855.602
Staatsanleihen	–	42.481.574	–	42.481.574
Mortgage-Backed Securities	–	22.645.649	–	22.645.649
Kommunalanleihen	–	1.278.776	–	1.278.776
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	3.337.129	–	3.337.129
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	440.690	–	–	440.690
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	124.708	–	124.708
Vermögenswerte insgesamt	**440.690**	**110.734.482**	**–**	**111.175.172**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(3.195.228)	–	(3.195.228)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(622.972)	–	–	(622.972)
Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swap-Kontrakten	–	(72.291)	–	(72.291)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(622.972)**	**(3.267.519)**	**–**	**(3.890.491)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	2.423.190	–	2.423.190
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	8.861.707	–	8.861.707
Unternehmensanleihen	–	44.359.194	–	44.359.194
Staatsanleihen	–	53.670.009	–	53.670.009
Mortgage-Backed Securities	–	19.062.981	–	19.062.981
Kommunalanleihen	–	1.706.806	–	1.706.806
Schatzwechsel	–	791.814	–	791.814
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.638.428	–	2.638.428
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	270.257	–	–	270.257
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	1.233	–	1.233
Vermögenswerte insgesamt	**270.257**	**133.515.362**	**–**	**133.785.619**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.908.377)	–	(1.908.377)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(191.230)	–	–	(191.230)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(13.185)	–	(13.185)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(191.230)**	**(1.921.562)**	**–**	**(2.112.792)**

Global Diversified Income FMP – 2024

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	18.765.889	–	18.765.889
Unternehmensanleihen	–	123.463.985	–	123.463.985
Staatsanleihen	–	1.727.993	–	1.727.993
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	281.732	–	281.732
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**144.239.599**	**–**	**144.239.599**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	150.336.737	–	150.336.737
Staatsanleihen	–	3.931.136	–	3.931.136
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	523.987	–	523.987
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**154.791.860**	**–**	**154.791.860**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(417)	–	(417)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(417)**	**–**	**(417)**

Global Equity Megatrends

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	141.492.601	–	–	141.492.601
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	444	–	444
Vermögenswerte insgesamt	**141.492.601**	**444**	**–**	**141.493.045**

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	7.576.699	(7.576.699)	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	75.013.478	4.451.857	–	79.465.335
Vermögenswerte insgesamt	**75.013.478**	**4.451.857**	**–**	**79.465.335**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	–	–	6.022.083	6.022.083
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	23.118.219	–	23.118.219
Unternehmensanleihen	–	295.514.545	758.917	296.273.462
Staatsanleihen	–	15.379.748	–	15.379.748
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	14.359.621	746.253	15.105.874
Investmentfonds	66.832	–	–	66.832
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	8.130.820	–	8.130.820
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	3.733.739	–	–	3.733.739
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	268.263	–	268.263
Vermögenswerte insgesamt	**3.800.571**	**356.771.216**	**7.527.253**	**368.099.040**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(3.447.658)	–	(3.447.658)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(5.173.223)	–	–	(5.173.223)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(5.173.223)**	**(3.447.658)**	**–**	**(8.620.881)**

* Eine Aktie und Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet. Eine mittelfristige Schuldverschreibung der Stufe 3 wurde basierend auf einer von einem Händler verfügbaren Einzelnotierung bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3			
Unternehmensanleihe	–	(247.792)	247.792

Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	24.079.041	–	24.079.041
Unternehmensanleihen	–	316.164.124	–	316.164.124
Aktien	–	–	5.247.334	5.247.334
Staatsanleihen	–	9.817.787	–	9.817.787
Investmentfonds	338.564	–	–	338.564
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	29.033.515	–	29.033.515
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	468.202	–	–	468.202
Vermögenswerte insgesamt	**806.766**	**379.094.467**	**5.247.334**	**385.148.567**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(10.857.921)	–	(10.857.921)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(515.955)	–	–	(515.955)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(632.100)	–	(632.100)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(515.955)**	**(11.490.021)**	**–**	**(12.005.976)**

Global SDG Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	530.465.171	2.034.310	532.499.481
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	4.933	–	4.933
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	11.935.674	–	11.935.674
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**542.405.778**	**2.034.310**	**544.440.088**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(6.738.234)	–	(6.738.234)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(6.738.234)**	**–**	**(6.738.234)**

* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)(g)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global SDG Engagement (Fortsetzung)

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3			
Unternehmensanleihen	–	(1.136.259)	1.136.259
Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2			
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	4.933	(4.933)

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Unternehmensanleihen von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.
Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden mittelfristige Schuldverschreibungen von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da diese die von den Direktoren genehmigten Bewertungsverfahren nicht mehr verwenden.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	273.005.334	–	273.005.334
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	687.601	325.875	1.013.476
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	12.873.530	–	12.873.530
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	13.411	–	13.411
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**286.579.876**	**325.875**	**286.905.751**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(9.426.254)	–	(9.426.254)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(9.426.254)**	**–**	**(9.426.254)**

Global High Yield Sustainable Action*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	14.443.671	–	14.443.671
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	95.881	–	95.881
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	7.620	–	7.620
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**14.547.172**	**–**	**14.547.172**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global High Yield Sustainable Action* (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(358.029)	–	(358.029)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(358.029)**	**–**	**(358.029)**

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	81.376.321	–	81.376.321
Staatsanleihen	–	2.082.454	–	2.082.454
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.115	–	1.115
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**83.459.890**	**–**	**83.459.890**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.107.450)	–	(1.107.450)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(1.107.450)**	**–**	**(1.107.450)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	80.767.363	–	80.767.363
Staatsanleihen	–	2.758.010	–	2.758.010
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	16.124	–	16.124
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**83.541.497**	**–**	**83.541.497**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.642.819)	–	(1.642.819)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(1.642.819)**	**–**	**(1.642.819)**

Global Opportunistic Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	1.817.743	–	1.817.743
Unternehmensanleihen	–	27.412.055	–	27.412.055
Staatsanleihen	–	21.133.383	–	21.133.383
Mortgage-Backed Securities	–	14.565.802	–	14.565.802
Investmentfonds	21.165	–	–	21.165
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	4.673.609	–	4.673.609
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	839.044	–	–	839.044
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	76	–	76
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	193.716	–	193.716
Vermögenswerte insgesamt	**860.209**	**69.796.384**	**–**	**70.656.593**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(6.577.836)	–	(6.577.836)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(356.573)	–	–	(356.573)
Nicht realisierter Verlust aus Credit Default Swap-Kontrakten	–	(821.571)	–	(821.571)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(27)	–	(27)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(356.573)**	**(7.399.434)**	**–**	**(7.756.007)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	307.820	–	307.820
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	4.290.102	–	4.290.102
Unternehmensanleihen	–	35.431.699	–	35.431.699
Staatsanleihen	–	24.711.043	–	24.711.043
Investmentfonds	107.216	1.694.000	–	1.801.216
Mortgage-Backed Securities	–	10.458.233	–	10.458.233
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.069.747	–	2.069.747
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	568.616	–	–	568.616
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	455.060	–	455.060
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	17.416	–	17.416
Vermögenswerte insgesamt	**675.832**	**79.435.120**	**–**	**80.110.952**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(4.857.533)	–	(4.857.533)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(607.164)	–	–	(607.164)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(64.729)	–	(64.729)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(141)	–	(141)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(607.164)**	**(4.922.403)**	**–**	**(5.529.567)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Real Estate Securities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	3.015.990	–	–	3.015.990
Immobilienaktiengesellschaften	17.071.668	–	–	17.071.668
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	422.478	–	422.478
Vermögenswerte insgesamt	**20.087.658**	**422.478**	**–**	**20.510.136**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(250.684)	–	(250.684)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(250.684)**	**–**	**(250.684)**

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	157.095	(157.095)	–
Immobilienaktiengesellschaften	1.198.728	(1.198.728)	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden eine Aktie und eine Immobilienaktiengesellschaft von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	5.878.530	967.525	–	6.846.055
Immobilienaktiengesellschaften	26.313.894	4.046.904	–	30.360.798
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	866.015	–	866.015
Vermögenswerte insgesamt	**32.192.424**	**5.880.444**	**–**	**38.072.868**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(147.763)	–	(147.763)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(147.763)**	**–**	**(147.763)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 1			
Immobilienaktiengesellschaften	404.924	–	(404.924)

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurden Immobilienaktiengesellschaften von Stufe 3 in Stufe 1 übertragen, da die Immobilienaktiengesellschaften die von den Direktoren genehmigten Bewertungsverfahren nicht mehr verwenden.

Global Sustainable Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	153.603.419	–	–	153.603.419
Vermögenswerte insgesamt	**153.603.419**	**–**	**–**	**153.603.419**

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	34.643.299	(34.643.299)	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	96.654.246	33.870.236	–	130.524.482
Vermögenswerte insgesamt	**96.654.246**	**33.870.236**	**–**	**130.524.482**

Global Sustainable Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	52.447.814	1.361.257	–	53.809.071
Immobilienaktiengesellschaften	1.116.404	–	–	1.116.404
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	66.448	–	66.448
Vermögenswerte insgesamt	**53.564.218**	**1.427.705**	**–**	**54.991.923**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global Sustainable Value (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(46.897)	–	(46.897)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(46.897)**	**–**	**(46.897)**

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	5.120.024	(5.120.024)	–
Immobilienaktiengesellschaften	87.109	(87.109)	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien und eine Immobilienaktiengesellschaft von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	37.427.578	9.532.811	–	46.960.389
Immobilienaktiengesellschaften	545.905	209.532	–	755.437
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	125.312	–	125.312
Vermögenswerte insgesamt	**37.973.483**	**9.867.655**	**–**	**47.841.138**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(90.456)	–	(90.456)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(90.456)**	**–**	**(90.456)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

High Yield Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	10.897.982	–	10.897.982
Unternehmensanleihen	–	1.984.515.926	14.661.425	1.999.177.351
Staatsanleihen	–	36.225.768	–	36.225.768
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	43.084.058	–	43.084.058
Investmentfonds	3.611.285	–	–	3.611.285
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	40.709.223	–	40.709.223
Vermögenswerte insgesamt	**3.611.285**	**2.115.432.957**	**14.661.425**	**2.133.705.667**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(15.391.406)	–	(15.391.406)
Nicht realisierter Verlust aus Return--Swap-Kontrakten	–	(51.928)	–	(51.928)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(15.443.334)**	**–**	**(15.443.334)**

* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3			
Unternehmensanleihen	–	(7.195.550)	7.195.550
Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2			
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	4.940	(4.940)

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Unternehmensanleihen von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.
Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde ein Laufzeitkredit von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen gestiegen sind.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	21.830.306	–	21.830.306
Unternehmensanleihen	–	1.982.553.426	–	1.982.553.426
Investmentfonds	18.294.706	–	–	18.294.706
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	85.843.814	5.791.687	91.635.501
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	55.707.544	–	55.707.544
Vermögenswerte insgesamt	**18.294.706**	**2.145.935.090**	**5.791.687**	**2.170.021.483**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(25.192.706)	–	(25.192.706)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(404.963)	–	(404.963)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(25.597.669)**	**–**	**(25.597.669)**

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2			
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	13.907.802	(13.907.802)

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurde ein Laufzeitkredit von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen gestiegen sind.

InnovAsia 5G

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	22.524.887	–	–	22.524.887
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	299.135	–	299.135
Vermögenswerte insgesamt	**22.524.887**	**299.135**	**–**	**22.824.022**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(60.136)	–	(60.136)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(60.136)**	**–**	**(60.136)**

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	1.003.652	(1.003.652)	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	13.493.208	379.300	–	13.872.508
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	453.339	–	453.339
Vermögenswerte insgesamt	**13.493.208**	**832.639**	**–**	**14.325.847**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(78.732)	–	(78.732)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(78.732)**	**–**	**(78.732)**

Japan Equity Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 JPY	Stufe 2 JPY	Stufe 3 JPY	Insgesamt JPY
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	15.961.893.000	–	–	15.961.893.000
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	128.484.079	–	128.484.079
Vermögenswerte insgesamt	**15.961.893.000**	**128.484.079**	**–**	**16.090.377.079**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 JPY	Stufe 2 JPY	Stufe 3 JPY	Insgesamt JPY
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(42.002.252)	–	(42.002.252)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(42.002.252)**	**–**	**(42.002.252)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 JPY	Stufe 2 JPY	Stufe 3 JPY	Insgesamt JPY
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	20.207.455.300	–	–	20.207.455.300
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	44.531.344	–	44.531.344
Vermögenswerte insgesamt	**20.207.455.300**	**44.531.344**	**–**	**20.251.986.644**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 JPY	Stufe 2 JPY	Stufe 3 JPY	Insgesamt JPY
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(141.215.249)	–	(141.215.249)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(141.215.249)**	**–**	**(141.215.249)**

Macro Opportunities FX

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	2.407.376	–	2.407.376
Staatsanleihen	–	347.166	–	347.166
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	4.627.295	–	4.627.295
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**7.381.837**	**–**	**7.381.837**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(4.613.695)	–	(4.613.695)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(4.613.695)**	**–**	**(4.613.695)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Macro Opportunities FX (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	24.967.521	–	24.967.521
Staatsanleihen	–	2.778.639	–	2.778.639
Schatzwechsel	–	4.389.983	–	4.389.983
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	3.617.207	–	3.617.207
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**35.753.350**	**–**	**35.753.350**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(4.428.576)	–	(4.428.576)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(4.428.576)**	**–**	**(4.428.576)**

Multi-Asset Income*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	7.644	–	7.644
Unternehmensanleihen	–	4.880.908	–	4.880.908
Aktien	2.520.628	327.820	–	2.848.448
Staatsanleihen	–	311.601	–	311.601
Investmentfonds	29.623	572.562	–	602.185
Gekaufte Optionskontrakte	4.207	–	–	4.207
Immobilienaktiengesellschaften	364.808	–	–	364.808
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	160.435	–	160.435
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	51.032	–	–	51.032
Vermögenswerte insgesamt	**2.970.298**	**6.260.970**	**–**	**9.231.268**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Multi-Asset Income* (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Verkaufte Optionskontrakte	(59.717)	–	–	(59.717)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(584.335)	–	(584.335)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(2.994)	–	–	(2.994)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(62.711)**	**(584.335)**	**–**	**(647.046)**

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Next Generation Mobility

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	149.804.841	1.389.795	–	151.194.636
Immobilienaktiengesellschaften	1.619.728	–	–	1.619.728
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	20.789	–	20.789
Vermögenswerte insgesamt	**151.424.569**	**1.410.584**	**–**	**152.835.153**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(10.365)	–	(10.365)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(10.365)**	**–**	**(10.365)**

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	10.502.393	(10.502.393)	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	129.334.927	7.542.858	–	136.877.785
Immobilienaktiengesellschaften	1.522.531	–	–	1.522.531
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	294.328	–	294.328
Vermögenswerte insgesamt	**130.857.458**	**7.837.186**	**–**	**138.694.644**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(213.661)	–	(213.661)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(213.661)**	**–**	**(213.661)**

Next Generation Space Economy[2]

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	17.658.423	1.016.293	–	18.674.716
Vermögenswerte insgesamt	**17.658.423**	**1.016.293**	**–**	**18.674.716**

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	2.205.585	(2.205.585)	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Aktien von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	6.156.111	1.825.563	–	7.981.674
Vermögenswerte insgesamt	**6.156.111**	**1.825.563**	**–**	**7.981.674**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Responsible Asian Debt - Hard Currency

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	2.496.736	–	2.496.736
Unternehmensanleihen	–	45.692.223	–	45.692.223
Staatsanleihen	–	12.025.196	–	12.025.196
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	127.055	–	127.055
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	255.858	–	–	255.858
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	575	–	575
Vermögenswerte insgesamt	**255.858**	**60.341.785**	**–**	**60.597.643**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(135.330)	–	(135.330)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(128.113)	–	–	(128.113)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(21)	–	(21)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(128.113)**	**(135.351)**	**–**	**(263.464)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	18.090.069	–	18.090.069
Staatsanleihen	–	2.090.986	–	2.090.986
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	34.382	–	34.382
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	47.079	–	–	47.079
Vermögenswerte insgesamt	**47.079**	**20.215.437**	**–**	**20.262.516**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(84.733)	–	(84.733)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(3.440)	–	–	(3.440)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(3.440)**	**(84.733)**	**–**	**(88.173)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration Emerging Market Debt

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	53.894.704	–	53.894.704
Unternehmensanleihen	–	2.405.987.373	500.000	2.406.487.373
Staatsanleihen	–	1.307.631.941	–	1.307.631.941
Investmentfonds	–	49.810.000	–	49.810.000
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	64.552.046	–	64.552.046
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**3.881.876.064**	**500.000**	**3.882.376.064**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(9.131.675)	–	(9.131.675)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(9.131.675)**	**–**	**(9.131.675)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	3.527.185.607	500.000	3.527.685.607
Staatsanleihen	–	1.205.827.702	–	1.205.827.702
Investmentfonds	–	70.347.000	–	70.347.000
Schatzwechsel	–	51.075.667	–	51.075.667
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	46.700.064	–	46.700.064
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**4.901.136.040**	**500.000**	**4.901.636.040**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	–	(1.843.240)	–	(1.843.240)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(23.986.773)	–	(23.986.773)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(25.830.013)**	**–**	**(25.830.013)**

* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3			
Unternehmensanleihen	–	(500.000)	500.000

Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

Short Duration High Yield SDG Engagement

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	659.326.845	4.686.892	664.013.737
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	12.793.556	626.491	13.420.047
Investmentfonds	241.028	–	–	241.028
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	15.254.920	–	15.254.920
Vermögenswerte insgesamt	**241.028**	**687.375.321**	**5.313.383**	**692.929.732**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(3.114.085)	–	(3.114.085)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(3.114.085)**	**–**	**(3.114.085)**

*Eine Unternehmensanleihe der Stufe 3 wurde in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.
Eine mittelfristige Schuldverschreibung der Stufe 3 wurde basierend auf einer von einem Händler verfügbaren Einzelnotierung bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3			
Unternehmensanleihen	–	(900.513)	900.513

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Unternehmensanleihe von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	477.638.711	–	477.638.711
Investmentfonds	1.221.039	–	–	1.221.039
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	23.578.927	–	23.578.927
Schatzwechsel	–	10.810.063	–	10.810.063
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	23.012.144	–	23.012.144
Vermögenswerte insgesamt	**1.221.039**	**535.039.845**	**–**	**536.260.884**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(5.286.451)	–	(5.286.451)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(5.286.451)**	**–**	**(5.286.451)**

Strategic Income

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	–	22.512	–	22.512
Schatzwechsel	–	221.166.130	–	221.166.130
Agency Bonds	–	781.434	–	781.434
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	211.031.917	–	211.031.917
Unternehmensanleihen	–	534.569.806	1.274.504	535.844.310
Staatsanleihen	–	175.669.880	–	175.669.880
Mortgage-Backed Securities	–	918.338.562	–	918.338.562
Kommunalanleihen	–	12.918.823	–	12.918.823
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	429.819	–	429.819
Investmentfonds	145.814	60.620.640	–	60.766.454
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	20.251.351	–	20.251.351
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	3.637.375	–	–	3.637.375
Beizulegender Zeitwert aus gekauften Swaptions	–	15.122	–	15.122
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	905.422	–	905.422
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	834.927	–	834.927
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	461.585	–	461.585
Vermögenswerte insgesamt	**3.783.189**	**2.158.017.930**	**1.274.504**	**2.163.075.623**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Strategic Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(5.513.615)	–	(5.513.615)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(18.576.468)	–	–	(18.576.468)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(1.085.681)	–	(1.085.681)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(18.576.468)**	**(6.599.296)**	**–**	**(25.175.764)**

* Unternehmensanleihen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3			
Unternehmensanleihen	–	(1.274.504)	1.274.504

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden bestimmte Unternehmensanleihen von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Agency Bonds	–	772.053	–	772.053
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	105.467.359	–	105.467.359
Unternehmensanleihen	–	637.567.177	–	637.567.177
Staatsanleihen	–	243.357.365	–	243.357.365
Investmentfonds	738.685	57.487.152	–	58.225.837
Mortgage-Backed Securities	–	346.893.475	–	346.893.475
Kommunalanleihen	–	20.744.098	–	20.744.098
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	453.664	126.140	579.804
Schatzwechsel	–	8.017.122	–	8.017.122
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	29.520.687	–	29.520.687
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	2.904.814	–	–	2.904.814
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	25.894	–	25.894
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	451.266	–	451.266
Vermögenswerte insgesamt	**3.643.499**	**1.450.757.312**	**126.140**	**1.454.526.951**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Strategic Income (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(7.161.491)	–	(7.161.491)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(1.425.842)	–	–	(1.425.842)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(97.587)	–	(97.587)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(916.187)	–	(916.187)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(3.863.949)	–	(3.863.949)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(1.425.842)**	**(12.039.214)**	**–**	**(13.465.056)**

* Mittelfristige Schuldverschreibungen der Stufe 3 wurden basierend auf von Händlern verfügbaren Einzelnotierungen bewertet. Das Portfolio hat keinen Zugang zu nicht beobachtbaren Parametern und kann daher derartige Parameter, die bei der Erstellung dieser Gleichung eingesetzt werden, nicht offenlegen.

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3			
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	(126.140)	126.140

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurde ein Laufzeitkredit von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da die für die Bewertung dieses Laufzeitkredits verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind.

Sustainable Asia High Yield

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	24.364.117	–	24.364.117
Staatsanleihen	–	2.505.094	–	2.505.094
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	16.926	–	16.926
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	23.897	–	–	23.897
Vermögenswerte insgesamt	**23.897**	**26.886.137**	**–**	**26.910.034**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(496)	–	(496)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(58.271)	–	–	(58.271)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(58.271)**	**(496)**	**–**	**(58.767)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	27.495.016	–	27.495.016
Staatsanleihen	–	837.924	–	837.924
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	282.337	–	282.337
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	13.122	–	–	13.122
Vermögenswerte insgesamt	**13.122**	**28.615.277**	**–**	**28.628.399**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(29.229)	–	(29.229)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(29.229)**	**–**	**(29.229)**

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	83.464.415	–	83.464.415
Staatsanleihen	–	7.168.384	–	7.168.384
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.906.675	–	1.906.675
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	27.031	–	–	27.031
Vermögenswerte insgesamt	**27.031**	**92.539.474**	**–**	**92.566.505**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(235.957)	–	(235.957)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(236.161)	–	–	(236.161)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(236.161)**	**(235.957)**	**–**	**(472.118)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	86.982.672	–	86.982.672
Staatsanleihen	–	4.401.408	–	4.401.408
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	853.222	–	853.222
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	49.937	–	–	49.937
Vermögenswerte insgesamt	**49.937**	**92.237.302**	**–**	**92.287.239**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(134.345)	–	(134.345)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(7.617)	–	–	(7.617)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(7.617)**	**(134.345)**	**–**	**(141.962)**

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	28.120.429	–	28.120.429
Staatsanleihen	–	387.681.779	–	387.681.779
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	8.781.301	–	8.781.301
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	7.590.987	–	–	7.590.987
Vermögenswerte insgesamt	**7.590.987**	**424.583.509**	**–**	**432.174.496**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(2.051.066)	–	(2.051.066)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(3.655.629)	–	–	(3.655.629)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(3.655.629)**	**(2.051.066)**	**–**	**(5.706.695)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2] (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	7.708.197	–	7.708.197
Staatsanleihen	–	136.106.159	–	136.106.159
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.237.337	–	1.237.337
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	2.512.729	–	–	2.512.729
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	53.826	–	53.826
Vermögenswerte insgesamt	**2.512.729**	**145.105.519**	**–**	**147.618.248**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(862.058)	–	(862.058)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(46.430)	–	–	(46.430)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(46.430)**	**(862.058)**	**–**	**(908.488)**

Tactical Macro[1]

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	22.994.103	–	22.994.103
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	67.331	–	67.331
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	8.973	–	–	8.973
Gekaufte Optionskontrakte	267.084	92.215	–	359.299
Vermögenswerte insgesamt	**276.057**	**23.153.649**	**–**	**23.429.706**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(36.811)	–	(36.811)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(28.337)	–	–	(28.337)
Verkaufte Optionskontrakte	(115.463)	(81.790)	–	(197.253)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(143.800)**	**(118.601)**	**–**	**(262.401)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Ultra Short Term Euro Bond

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Schatzwechsel	–	8.960.964	–	8.960.964
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	90.687.160	–	90.687.160
Unternehmensanleihen	–	789.167.617	–	789.167.617
Staatsanleihen	–	75.386.047	–	75.386.047
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	235.719	–	235.719
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	509.420	–	–	509.420
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	531.378	–	531.378
Vermögenswerte insgesamt	**509.420**	**964.968.885**	**–**	**965.478.305**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(2.512.078)	–	(2.512.078)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(2.783.686)	–	–	(2.783.686)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(2.179.454)	–	(2.179.454)
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	(293.227)	–	(293.227)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(248.422)	–	(248.422)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(2.783.686)**	**(5.233.181)**	**–**	**(8.016.867)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Forderungsbesicherte Wertpapiere (ABS-Anleihen)	–	72.343.961	–	72.343.961
Unternehmensanleihen	–	670.503.994	–	670.503.994
Staatsanleihen	–	56.450.113	–	56.450.113
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	9.296	–	9.296
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	232.108	–	232.108
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	9.402.701	–	–	9.402.701
Vermögenswerte insgesamt	**9.402.701**	**799.539.472**	**–**	**808.942.173**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 EUR	Stufe 2 EUR	Stufe 3 EUR	Insgesamt EUR
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(6.570.781)	–	(6.570.781)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(1.719.108)	–	–	(1.719.108)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(543.950)	–	(543.950)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(1.735.988)	–	(1.735.988)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(1.719.108)**	**(8.850.719)**	**–**	**(10.569.827)**

Uncorrelated Strategies

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	120.618.827	–	120.618.827
Aktien	77.292.452	–	–	77.292.452
Staatsanleihen	–	38.964.571	–	38.964.571
Participatory Notes	16.551	20.494	–	37.045
Immobilienaktiengesellschaften	1.217.656	–	–	1.217.656
Schatzwechsel	–	707.195.701	–	707.195.701
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	91.871.867	–	91.871.867
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	18.420.818	–	–	18.420.818
Gekaufte Optionskontrakte	76.813.301	205.683.748	739.333	283.236.382
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	–	106.922.939	622	106.923.561
Gekaufte Swaptions	–	40.202	–	40.202
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	686.246	–	686.246
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	3.727.082	–	3.727.082
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	3.395.463	–	3.395.463
Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten	–	379.911	–	379.911
Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten	–	85.377	3.742.835	3.828.212
Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	15.951.941	2.474.234	18.426.175
Vermögenswerte insgesamt	**173.760.778**	**1.295.544.369**	**6.957.024**	**1.476.262.171**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(53.084.382)	–	(53.084.382)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(24.576.840)	(16.558)	–	(24.593.398)
Verkaufte Optionskontrakte	(24.217.092)	(354.499.520)	(612)	(378.717.224)
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	(20.286.524)	(404.714)	(20.691.238)
Verkaufte Swaptionen	–	(29.043)	–	(29.043)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(1.305.860)	–	(1.305.860)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(9.089.737)	–	(9.089.737)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(3.021.166)	–	(3.021.166)
Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten	–	(418.672)	(96.004)	(514.676)
Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	(8.805.597)	(105.892)	(8.911.489)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(48.793.932)**	**(450.557.059)**	**(607.222)**	**(499.958.213)**

* Optionskontrakte, Differenzkontrakte, Variance- und Volatility-Swaps der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren und/oder auf der Basis der Notierung eines einzigen Händlers bewertet.

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2			
Optionskontrakte	(425.350)	425.350	–
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 3			
Variance-Swap-Kontrakte	–	(446.251)	446.251
Volatility-Swap-Kontrakte	–	(1.641.552)	1.641.552
Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 3			
Differenzkontrakte	(622)	–	622
Optionskontrakte	(55.703)	–	55.703

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden Optionskontrakte und Differenzkontrakte von Stufe 1 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden. Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden Optionskontrakte von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind. Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurden Variance-Swap-Kontrakte und Volatility-Swap-Kontrakte von Stufe 2 in Stufe 3 übertragen, da von den Direktoren genehmigten Preisfindungsverfahren verwendet werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	161.387.060	–	161.387.060
Aktien	135.368.028	–	–	135.368.028
Staatsanleihen	–	4.218.750	–	4.218.750
Participatory Notes	21.440	–	–	21.440
Immobilienaktiengesellschaften	4.976.282	–	–	4.976.282
Schatzwechsel	–	1.582.793.462	–	1.582.793.462
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	212.294.005	–	212.294.005
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	40.643.851	–	–	40.643.851
Gekaufte Optionskontrakte	73.572.721	128.636.328	551.147	202.760.196
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	–	78.117.298	714	78.118.012
Gekaufte Swaptions	–	1.388.392	–	1.388.392
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	1.435.658	–	1.435.658
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	65.682.162	–	65.682.162
Nicht realisierter Gewinn aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	27.160.802	–	27.160.802
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	3.899.449	–	3.899.449
Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten	–	700.944	–	700.944
Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten	–	971.550	–	971.550
Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	32.121.676	–	32.121.676
Vermögenswerte insgesamt	**254.582.322**	**2.300.807.536**	**551.861**	**2.555.941.719**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(37.812.332)	–	(37.812.332)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(25.288.052)	–	–	(25.288.052)
Verkaufte Optionskontrakte	(25.955.164)	(284.022.074)	(5.880)	(309.983.118)
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	(58.427.650)	(288.575)	(58.716.225)
Verkaufte Swaptionen	–	(708.024)	–	(708.024)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(526.998)	–	(526.998)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(23.945.145)	–	(23.945.145)
Nicht realisierter Verlust aus Inflation-Swap-Kontrakten	–	(26.861.904)	–	(26.861.904)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(1.242.422)	–	(1.242.422)
Nicht realisierter Verlust aus Correlation-Swap-Kontrakten	–	(60.576)	–	(60.576)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten (Fortsetzung)				
Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten	–	(421.247)	–	(421.247)
Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	(4.417.825)	–	(4.417.825)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(51.243.216)**	**(438.446.197)**	**(294.455)**	**(489.983.868)**

* Optionen und Differenzkontrakte der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren und/oder auf der Basis der Notierung eines einzigen Händlers bewertet.

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 3 in Stufe 2			
Differenzkontrakte	–	215.193	(215.193)
Correlation-Swap-Kontrakte	–	700.944	(700.944)
Volatility-Swap-Kontrakte	–	17.959.222	(17.959.222)
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	100.661.159	(100.661.159)	–
Participatory Notes	6.404	(6.404)	–
Immobilienaktiengesellschaften	4.976.282	(4.976.282)	–

Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurden Correlation Swap-Kontrakte und Volatility Swap-Kontrakte von Stufe 3 in Stufe 2 übertragen, da die von den Direktoren genehmigten Bewertungsverfahren nicht mehr verwendet werden. Zum Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 wurden Aktien, Participatory Notes und Immobilienaktiengesellschaften von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Trading[2]*

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3** US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	13.221.435	–	13.221.435
Aktien	16.089.324	–	–	16.089.324
Immobilienaktiengesellschaften	3.946.436	–	–	3.946.436
Schatzwechsel	–	449.200.010	–	449.200.010
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	54.485.356	–	54.485.356
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	8.521.839	–	–	8.521.839
Gekaufte Optionskontrakte	15.415.785	20.361.008	81.777	35.858.570
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	–	13.934.583	–	13.934.583
Gekaufte Swaptions	–	68.848	–	68.848
Nicht realisierter Gewinn aus Zinsswapkontrakten	–	1.024.404	–	1.024.404
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	678.244	–	678.244
Nicht realisierter Gewinn aus Variance-Swap-Kontrakten	–	319.127	–	319.127
Nicht realisierter Gewinn aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	1.343.255	–	1.343.255
Nicht realisierter Gewinn aus Correlation-Swap-Kontrakten	–	0	–	0
Vermögenswerte insgesamt	**43.973.384**	**554.636.270**	**81.777**	**598.691.431**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3** US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(6.317.151)	–	(6.317.151)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(4.922.598)	–	–	(4.922.598)
Verkaufte Optionskontrakte	(5.613.286)	(36.846.894)	–	(42.460.180)
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	(3.269.736)	–	(3.269.736)
Verkaufte Swaptionen	–	(20.738)	–	(20.738)
Beizulegender Zeitwert aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	–	(47.926)	–	(47.926)
Nicht realisierter Verlust aus Zinsswapkontrakten	–	(1.000.582)	–	(1.000.582)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(13.154)	–	(13.154)
Nicht realisierter Verlust aus Variance-Swap-Kontrakten	–	(332.219)	–	(332.219)
Nicht realisierter Verlust aus Volatility-Swap-Kontrakten	–	(939.941)	–	(939.941)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(10.535.884)**	**(48.788.341)**	**–**	**(59.324.225)**

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.
**Alle Optionen der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	45.872.647	–	–	45.872.647
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.253.492	–	1.253.492
Vermögenswerte insgesamt	**45.872.647**	**1.253.492**	**–**	**47.126.139**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(118.963)	–	(118.963)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(118.963)**	**–**	**(118.963)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	27.005.260	–	–	27.005.260
Immobilienaktiengesellschaften	478.769	–	–	478.769
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.158.080	–	2.158.080
Vermögenswerte insgesamt	**27.484.029**	**2.158.080**	**–**	**29.642.109**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(546.931)	–	(546.931)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(546.931)**	**–**	**(546.931)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Equity Index PutWrite

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Staatsanleihen	–	663.357.136	–	663.357.136
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	12.128.805	–	12.128.805
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**675.485.941**	**–**	**675.485.941**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(538.104)	–	(538.104)
Verkaufte Optionskontrakte	(5.184.365)	(67.430)	–	(5.251.795)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(5.184.365)**	**(605.534)**	**–**	**(5.789.899)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Staatsanleihen	–	632.264.076	–	632.264.076
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	16.592.327	–	16.592.327
Vermögenswerte insgesamt	**–**	**648.856.403**	**–**	**648.856.403**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Verkaufte Optionskontrakte	(12.932.325)	–	–	(12.932.325)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.350.871)	–	(1.350.871)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(12.932.325)**	**(1.350.871)**	**–**	**(14.283.196)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Large Cap Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	1.847.675.317	–	–	1.847.675.317
Immobilienaktiengesellschaften	3.901.309	–	–	3.901.309
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.119.012	–	1.119.012
Vermögenswerte insgesamt	**1.851.576.626**	**1.119.012**	**–**	**1.852.695.638**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(115.827)	–	(115.827)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(115.827)**	**–**	**(115.827)**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	1.688.625.847	–	–	1.688.625.847
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	973.737	–	973.737
Vermögenswerte insgesamt	**1.688.625.847**	**973.737**	**–**	**1.689.599.584**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(102.612)	–	(102.612)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(102.612)**	**–**	**(102.612)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Long Short Equity

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	165.044.733	–	1.538.670	166.583.403
Immobilienaktiengesellschaften	3.534.047	–	–	3.534.047
Unternehmensanleihen	–	7.670.535	–	7.670.535
Mittelfristige Schuldverschreibungen	–	–	487.831	487.831
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	3.283.704	–	3.283.704
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	–	624.429	–	624.429
Vermögenswerte insgesamt	**168.578.780**	**11.578.668**	**2.026.501**	**182.183.949**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(342.870)	–	(342.870)
Nicht realisierter Verlust aus Futures-Kontrakten	(1.003.428)	–	–	(1.003.428)
Verkaufte Optionskontrakte	(15.714)	–	–	(15.714)
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	(2.740.096)	–	(2.740.096)
Nicht realisierter Verlust aus Return--Swap-Kontrakten	–	(4.635.993)	–	(4.635.993)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(1.019.142)**	**(7.718.959)**	**–**	**(8.738.101)**

* Eine Aktie, eine Unternehmensanleihe und eine mittelfristige Schuldverschreibung der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 2 in Stufe 1			
Aktien	1.648.923	(1.648.923)	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 2 in Stufe 1 übertragen, da die Preisfindung durch einen Pricing-Anbieter erfolgte.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Unternehmensanleihen	–	8.400.448	–	8.400.448
Aktien	156.744.366	1.265.964	–	158.010.330
Participatory Notes	3.750	–	–	3.750
Immobilienaktiengesellschaften	1.744.930	–	–	1.744.930
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	6.686.844	–	6.686.844
Nicht realisierter Gewinn aus Futures-Kontrakten	470.254	–	–	470.254
Nicht realisierter Gewinn aus Differenzkontrakten	–	3.162.728	–	3.162.728
Nicht realisierter Gewinn aus Total Return Swap-Kontrakten	–	664.406	–	664.406
Vermögenswerte insgesamt	**158.963.300**	**20.180.390**	**–**	**179.143.690**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Verkaufte Optionskontrakte	(74.360)	–	–	(74.360)
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(822.791)	–	(822.791)
Nicht realisierter Verlust aus Differenzkontrakten	–	(1.291.811)	–	(1.291.811)
Nicht realisierter Verlust aus Total Return Swap-Kontrakten	–	(700.901)	–	(700.901)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**(74.360)**	**(2.815.503)**	**–**	**(2.889.863)**

US Multi Cap Opportunities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	396.982.739	–	–	396.982.739
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	1.843.892	–	1.843.892
Vermögenswerte insgesamt	**396.982.739**	**1.843.892**	**–**	**398.826.631**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(325.170)	–	(325.170)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(325.170)**	**–**	**(325.170)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	439.025.865	–	–	439.025.865
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.736.142	–	2.736.142
Vermögenswerte insgesamt	**439.025.865**	**2.736.142**	**–**	**441.762.007**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(587.402)	–	(587.402)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(587.402)**	**–**	**(587.402)**

US Real Estate Securities

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Immobilienaktiengesellschaften	519.992.632	–	–	519.992.632
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	2.358.847	–	2.358.847
Vermögenswerte insgesamt	**519.992.632**	**2.358.847**	**–**	**522.351.479**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(441.683)	–	(441.683)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(441.683)**	**–**	**(441.683)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Immobilienaktiengesellschaften	624.531.489	–	–	624.531.489
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	4.089.640	–	4.089.640
Vermögenswerte insgesamt	**624.531.489**	**4.089.640**	**–**	**628.621.129**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(1.230.032)	–	(1.230.032)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(1.230.032)**	**–**	**(1.230.032)**

US Small Cap

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	618.452.600	3.839.310	–	622.291.910
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	747.370	–	747.370
Vermögenswerte insgesamt	**618.452.600**	**4.586.680**	**–**	**623.039.280**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(137.144)	–	(137.144)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(137.144)**	**–**	**(137.144)**

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$
Übertragungen von Stufe 1 in Stufe 2			
Aktien	(3.839.310)	3.839.310	–

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 wurde eine Aktie von Stufe 1 in Stufe 2 übertragen, da die für die Bewertung verfügbaren Dealerquotierungen zurückgegangen sind.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Small Cap (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	578.779.674	–	–	578.779.674
Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten	–	949.457	–	949.457
Vermögenswerte insgesamt	**578.779.674**	**949.457**	**–**	**579.729.131**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3 US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	**–**	(236.699)	**–**	(236.699)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(236.699)**	**–**	**(236.699)**

US Small Cap Intrinsic Value

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	299.826.372	–	–	299.826.372
Immobilienaktiengesellschaften	1.910.421	–	–	1.910.421
Vermögenswerte insgesamt	**301.736.793**	**–**	**–**	**301.736.793**

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten
Zum 31. Dezember 2023

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten				
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	–	(398)	–	(398)
Verbindlichkeiten, insgesamt	**–**	**(398)**	**–**	**(398)**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

Finanzinstrumente, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten

Zum 31. Dezember 2022

	Stufe 1 US$	Stufe 2 US$	Stufe 3* US$	Insgesamt US$
Für den Handel gehaltene finanzielle Vermögenswerte				
Aktien	184.718.734	–	–	184.718.734
Immobilienaktiengesellschaften	2.170.638	–	–	2.170.638
Vermögenswerte insgesamt	**186.889.372**	**–**	**–**	**186.889.372**

* Eine Aktie und eine Unternehmensanleihe der Stufe 3 wurden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Die folgende Aufstellung enthält eine Überleitung der Anlagen, deren Wert per 31. Dezember 2023 unter Anwendung nicht beobachtbarer Parameter (Stufe 3) ermittelt wurde:

Absolute Return Multi Strategy*

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2023	6.766
Realisierter Nettoverlust	(4)
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(451)
Saldo per 31. Dezember 2023	**6.311**

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Global Flexible Credit Income

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2023	5.247.334
Käufe	1.293.983
Übertragung in Stufe 3	247.792
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	738.144
Saldo per 31. Dezember 2023	**7.527.253**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)(g)

Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Global SDG Engagement

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2023	325.875
Käufe	1.847.363
Verkäufe	(1.206.234)
Realisierter Nettogewinn	686
Übertragung in Stufe 3	1.136.259
Übertragung aus Stufe 3	(4.933)
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(64.706)
Saldo per 31. Dezember 2023	**2.034.310**

High Yield Bond

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2023	5.791.687
Käufe	16.834.056
Verkäufe	(13.429.241)
Realisierter Nettoverlust	(340.284)
Übertragung in Stufe 3	7.195.550
Übertragung aus Stufe 3	(4.940)
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(1.385.403)
Saldo per 31. Dezember 2023	**14.661.425**

Short Duration Emerging Market Debt

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2023	500.000
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	–
Saldo per 31. Dezember 2023	**500.000**

Short Duration High Yield SDG Engagement

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2023	–
Käufe	8.248.058
Verkäufe	(3.688.538)
Realisierter Nettogewinn	97.959
Übertragung in Stufe 3	900.513
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(244.609)
Saldo per 31. Dezember 2023	**5.313.383**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Strategic Income

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2023	126.140
Käufe	796.760
Verkäufe	(299.057)
Realisierter Nettoverlust	(60.212)
Übertragung in Stufe 3	605.611
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	105.262
Saldo per 31. Dezember 2023	**1.274.504**

Uncorrelated Trading*

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2023	81.777
Verkäufe	(42.151)
Realisierter Nettoverlust	(963.789)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	924.163
Saldo per 31. Dezember 2023	**–**

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2024 aufgelöst.

Uncorrelated Strategies

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2023	257.406
Käufe	8.232.754
Verkäufe	(180.900)
Übertragung in Stufe 3	2.144.128
Realisierter Nettoverlust	(11.232.258)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	7.128.672
Saldo per 31. Dezember 2023	**6.349.802**

US Long Short Equity

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2023	–
Käufe	2.026.501
Saldo per 31. Dezember 2023	**2.026.501**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Die folgende Aufstellung enthält eine Überleitung der Anlagen, deren Wert per 31. Dezember 2022 unter Anwendung nicht beobachtbarer Parameter (Stufe 3) ermittelt wurde:

Absolute Return Multi Strategy*

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2022	31.388
Verkäufe	(32.202)
Realisierter Nettogewinn	32.201
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(24.621)
Saldo per 31. Dezember 2022	**6.766**

* Das Portfolio wurde am 20. Dezember 2021 aufgelöst.

Global Flexible Credit Income

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2022	–
Käufe	4.900.000
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	347.334
Saldo per 31. Dezember 2022	**5.247.334**

Global SDG Engagement

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2022	–
Käufe	329.588
Verkäufe	(833)
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(2.880)
Saldo per 31. Dezember 2022	**325.875**

High Yield Bond

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2022	26.761.291
Käufe	6.332.158
Verkäufe	(12.108.694)
Realisierter Nettoverlust	(337.028)
Übertragung aus Stufe 3	(13.907.802)
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(948.237)
Saldo per 31. Dezember 2022	**5.791.688**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Multi-Asset Income

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2022	76
Käufe	6
Realisierter Nettoverlust	(104)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	22
Saldo per 31. Dezember 2022	**–**

Short Duration Emerging Market Debt

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2022	–
Übertragung in Stufe 3	500.000
Saldo per 31. Dezember 2022	**500.000**

Short Duration High Yield SDG Engagement

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2022	1.599.050
Verkäufe	(1.595.047)
Realisierter Nettogewinn	7.428
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(11.431)
Saldo per 31. Dezember 2022	**–**

Strategic Income

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2022	1.573.993
Käufe	(145.736)
Verkäufe	(1.411.261)
Realisierter Nettogewinn	1.032
Übertragung in Stufe 3	126.140
Nettoveränderung des nicht realisierten Verlustes	(18.028)
Saldo per 31. Dezember 2022	**126.140**

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

12. ANGABEN ZU FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

(g) Beizulegender Zeitwert von Anlagen (Fortsetzung)

Uncorrelated Strategies

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2022	853.542
Käufe	774.404.693
Verkäufe	(776.937.850)
Realisierter Nettogewinn	10.300.712
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes	10.511.668
Übertragung aus Stufe 3	(18.660.166)
Übertragung in Stufe 3	(215.193)
Saldo per 31. Dezember 2022	**257.406**

Uncorrelated Trading[1]

	Insgesamt US$
Saldo per 1. Januar 2022	–
Käufe	1.031.664
Verkäufe	(25.724)
Nettoveränderung des nicht realisierten Gewinnes/(Verlustes)	(924.163)
Saldo per 31. Dezember 2022	**81.777**

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

Laufzeitkredite der Stufe 3 sind in erster Linie auf die Preisfindungsmethode zurückzuführen, bei der eine einzelne Broker-Quotierungen (Stufe 3) oder ein einzelner beobachtbare Parameter (Stufe 3) durch den unabhängigen Pricing-Service-Anbieter verwendet wird. Alle anderen Wertpapiere der Stufe 3 werden in Übereinstimmung mit den von den Direktoren genehmigten Verfahren bewertet.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT

5G Connectivity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD A NIW	Thesaurierende Klasse AUD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD I2* NIW	Thesaurierende Klasse AUD I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF A* NIW	Thesaurierende Klasse CHF A* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	20.787.257 AUD	10,77 AUD	52.808 AUD	11,32 AUD	27.888 CHF	10,62 CHF
31. Dezember 2022	17.057.259 AUD	7,98 AUD	–	–	–	–
31. Dezember 2021	38.403.196 AUD	14,75 AUD	–	–	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I2* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CNY A NIW	Thesaurierende Klasse CNY A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	27.986 CHF	10,65 CHF	30.421 CHF	11,37 CHF	2.264.556 CNY	76,51 CNY
31. Dezember 2022	–	–	–	–	2.370.930 CNY	57,01 CNY
31. Dezember 2021	–	–	–	–	5.346.016 CNY	101,38 CNY

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CNY I2* NIW	Thesaurierende Klasse CNY I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	247.376 CNY	113,42 CNY	44.215.951 EUR	11,22 EUR	54.229.594 EUR	12,48 EUR
31. Dezember 2022	–	–	43.082.992 EUR	8,32 EUR	54.125.094 EUR	9,34 EUR
31. Dezember 2021	–	–	114.367.513 EUR	15,39 EUR	95.941.544 EUR	15,55 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	40.203.669 EUR	10,50 EUR	44.112.500 EUR	12,14 EUR	31.606 EUR	11,32 EUR
31. Dezember 2022	39.268.790 EUR	7,73 EUR	43.589.698 EUR	9,01 EUR	–	–
31. Dezember 2021	76.903.936 EUR	14,16 EUR	118.101.577 EUR	14,87 EUR	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP A NIW	Thesaurierende Klasse GBP A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	18.694 EUR	9,51 EUR	58.300.824 EUR	12,11 EUR	9.193.764 GBP	11,57 GBP
31. Dezember 2022	1.352.834 EUR	6,97 EUR	44.772.549 EUR	9,14 EUR	10.322.335 GBP	8,45 GBP
31. Dezember 2021	3.965.517 EUR	12,72 EUR	69.554.657 EUR	15,33 EUR	23.031.741 GBP	15,43 GBP

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I2* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse HKD A NIW	Thesaurierende Klasse HKD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	295.419 GBP	10,28 GBP	27.290 GBP	11,37 GBP	49.137.389 HKD	12,04 HKD
31. Dezember 2022	535.353 GBP	7,81 GBP	–	–	47.629.183 HKD	8,80 HKD
31. Dezember 2021	1.009.328 GBP	12,20 GBP	–	–	133.998.798 HKD	15,70 HKD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse HKD I2* NIW	Thesaurierende Klasse HKD I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD I2* NIW	Thesaurierende Klasse SGD I2* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	267.255 HKD	11,39 HKD	41.638.661 SGD	23,47 SGD	46.226 SGD	22,67 SGD
31. Dezember 2022	–	–	39.375.609 SGD	17,27 SGD	–	–
31. Dezember 2021	–	–	90.358.002 SGD	31,05 SGD	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD E* NIW	Thesaurierende Klasse USD E* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	439.282.138 USD	12,60 USD	708.213 USD	11,92 USD	126.685.506 USD	13,65 USD
31. Dezember 2022	421.532.776 USD	9,12 USD	–	–	144.216.650 USD	9,79 USD
31. Dezember 2021	998.982.677 USD	16,17 USD	–	–	426.247.636 USD	17,22 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	21.016.657 USD	13,65 USD	852.918 USD	8,74 USD	83.057.543 USD	9,30 USD
31. Dezember 2022	18.941.211 USD	9,79 USD	6.231.632 USD	6,26 USD	64.460.647 USD	6,65 USD
31. Dezember 2021	53.711.877 USD	17,21 USD	10.938.003 USD	10,98 USD	124.140.837 USD	11,67 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	15.006.722 USD	12,70 USD	25.425.604 USD	11,02 USD	951.757 USD	8,78 USD
31. Dezember 2022	11.306.667 USD	9,07 USD	23.507.641 USD	8,04 USD	700.508 USD	6,24 USD
31. Dezember 2021	39.945.606 USD	15,89 USD	50.689.515 USD	14,37 USD	954.074 USD	10,88 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR A* NIW	Thesaurierende Klasse ZAR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR E* NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	3.680.438 ZAR	125,63 ZAR	2.072.410 ZAR	126,25 ZAR

China A-Share Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CNY I NIW	Thesaurierende Klasse CNY I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	117.417 CNY	80,34 CNY	23.194 USD	7,90 USD	1.974.225 USD	7,89 USD
31. Dezember 2022	133.897 CNY	91,62 CNY	27.220 USD	9,28 USD	2.319.140 USD	9,27 USD
31. Dezember 2021	173.171 CNY	118,49 CNY	578.160 USD	13,05 USD	3.263.395 USD	13,05 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

China Bond

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CNY I* NIW	Ausschüttende Klasse CNY I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CNY Z NIW	Thesaurierende Klasse CNY Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	152.534 CNY	76,55 CNY	212.640 CNY	90,61 CNY	218.817 CNY	119,47 CNY
31. Dezember 2022	156.137 CNY	78,36 CNY	209.325 CNY	89,19 CNY	210.297 CNY	114,82 CNY
31. Dezember 2021	177.774 CNY	89,21 CNY	1.406.816 CNY	97,60 CNY	222.548 CNY	121,51 CNY

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	–	–	20.687 GBP	9,51 GBP
31. Dezember 2022	–	–	–	–	19.572 GBP	9,00 GBP
31. Dezember 2021	75.956 EUR	9,49 EUR	581.939 EUR	10,39 EUR	43.285 GBP	9,69 GBP

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	704.160 SGD	13,71 SGD	3.072.338 USD	10,27 USD	48.865.775 USD	10,14 USD
31. Dezember 2022	1.003.087 SGD	14,69 SGD	5.761.473 USD	10,22 USD	47.003.040 USD	9,49 USD
31. Dezember 2021	3.571.270 SGD	18,30 SGD	21.420.695 USD	11,85 USD	52.475.111 USD	10,13 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	11.943.662 USD	9,88 USD
31. Dezember 2022	11.882.617 USD	9,78 USD
31. Dezember 2021	13.733.211 USD	11,26 USD

China Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I NIW	Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	164.919 CHF	9,11 CHF	874.281 EUR	16,18 EUR	886.658 EUR	17,69 EUR
31. Dezember 2022	355.994 CHF	12,23 CHF	1.489.033 EUR	21,49 EUR	1.254.577 EUR	23,33 EUR
31. Dezember 2021	468.597 CHF	16,10 CHF	2.593.043 EUR	28,39 EUR	1.813.319 EUR	30,58 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP A NIW	Ausschüttende Klasse GBP A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	12.316 EUR	13,82 EUR	10.372 GBP	8,15 GBP	–	–
31. Dezember 2022	16.058 EUR	18,02 EUR	13.559 GBP	10,70 GBP	–	–
31. Dezember 2021	20.820 EUR	23,36 EUR	226.611 GBP	13,93 GBP	276.624 GBP	28,73 GBP

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.478.317 SGD	22,90 SGD	16.602.580 USD	19,81 USD	589.764 USD	12,15 USD
31. Dezember 2022	2.180.349 SGD	30,18 SGD	28.844.956 USD	25,67 USD	786.778 USD	15,80 USD
31. Dezember 2021	3.238.056 SGD	39,04 SGD	49.687.137 USD	32,88 USD	1.619.142 USD	20,24 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	120.715.813 USD	21,74 USD	21.040.703 USD	13,47 USD	15.431 USD	11,38 USD
31. Dezember 2022	240.949.106 USD	27,95 USD	15.248.435 USD	17,28 USD	20.188 USD	14,88 USD
31. Dezember 2021	363.801.495 USD	35,53 USD	21.510.739 USD	21,91 USD	43.760.360 USD	19,25 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD U NIW	Thesaurierende Klasse USD U NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	15.726.473 USD	13,90 USD	239.524 USD	14,81 USD
31. Dezember 2022	26.266.970 USD	17,93 USD	304.598 USD	18,83 USD
31. Dezember 2021	39.927.816 USD	22,88 USD	383.001 USD	23,68 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Climate Innovation[1]

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	9.662 USD	9,66 USD	9.696 USD	9,70 USD	9.713 USD	9,71 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.919.017 USD	9,73 USD

CLO Income

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	32.309 EUR	11,44 EUR	31.596.103 EUR	12,20 EUR	10.206.824 EUR	8,52 EUR
31. Dezember 2022	62.426 EUR	9,67 EUR	11.405.488 EUR	10,23 EUR	12.590.646 EUR	7,90 EUR
31. Dezember 2021	–	–	2.024.965 EUR	11,21 EUR	14.114.006 EUR	9,24 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I2* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I5* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	–	–	63.534 GBP	13,09 GBP
31. Dezember 2022	22.140.124 GBP	8,17 GBP	–	–	52.625 GBP	10,84 GBP
31. Dezember 2021	30.837.441 GBP	9,37 GBP	26.082 GBP	9,38 GBP	82.828 GBP	11,60 GBP

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SEK I NIW	Thesaurierende Klasse SEK I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	30.311.516 SEK	124,19 SEK	42.064 USD	11,87 USD	58.957.866 USD	13,62 USD
31. Dezember 2022	29.102.703 SEK	104,04 SEK	62.292 USD	9,83 USD	14.305.878 USD	11,19 USD
31. Dezember 2021	34.950.701 SEK	113,40 SEK	–	–	18.681.077 USD	12,02 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I* NIW	Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I5 NIW	Ausschüttende Klasse USD I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.616.887 USD	10,42 USD	42.131.223 USD	9,99 USD	31.820.798 USD	9,51 USD
31. Dezember 2022	–	–	30.076.757 USD	9,09 USD	37.889.294 USD	8,65 USD
31. Dezember 2021	–	–	25.769.475 USD	10,40 USD	40.735.952 USD	9,89 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	723.771 USD	14,15 USD
31. Dezember 2022	491.530 USD	11,53 USD
31. Dezember 2021	524.027 USD	12,30 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Commodities[2]

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	42.161.474 GBP	9,20 GBP	30.032.518 GBP	8,74 GBP	1.138.135 USD	9,00 USD
31. Dezember 2022	8.401 GBP	10,43 GBP	16.248.150 GBP	9,42 GBP	2.916.591 USD	9,71 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.744.147 USD	10,47 USD	55.640.585 USD	9,17 USD	379.973 USD	8,21 USD
31. Dezember 2022	247.698 USD	11,20 USD	59.937.610 USD	9,78 USD	432.835 USD	8,91 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.438.888 USD	10,65 USD
31. Dezember 2022	2.656.009 USD	11,32 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF P NIW	Thesaurierende Klasse CHF P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CHF P NIW	Ausschüttende Klasse CHF P NIW je Anteil
31. Dezember 2023	5.093.356 AUD	8,02 AUD	4.766.253 CHF	10,24 CHF	1.630.621 CHF	9,00 CHF
31. Dezember 2022	4.816.413 AUD	7,88 AUD	22.917.824 CHF	9,64 CHF	1.547.416 CHF	8,79 CHF
31. Dezember 2021	9.317.570 AUD	9,58 AUD	54.604.181 CHF	11,27 CHF	2.871.450 CHF	10,61 CHF

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	39.329.425 EUR	8,09 EUR	150.158.972 EUR	11,14 EUR	861.799.950 EUR	11,96 EUR
31. Dezember 2022	38.403.169 EUR	7,91 EUR	124.371.360 EUR	10,36 EUR	655.035.193 EUR	11,06 EUR
31. Dezember 2021	49.140.644 EUR	9,67 EUR	181.457.452 EUR	12,14 EUR	668.648.608 EUR	12,88 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	160.639.032 EUR	9,38 EUR	258.577.307 EUR	11,04 EUR	54.536.069 EUR	8,55 EUR
31. Dezember 2022	92.907.803 EUR	8,98 EUR	191.477.785 EUR	10,20 EUR	177.916.143 EUR	8,19 EUR
31. Dezember 2021	102.802.041 EUR	10,80 EUR	297.187.874 EUR	11,86 EUR	177.907.878 EUR	9,85 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	4.512.654 EUR	11,16 EUR	112.450.285 EUR	12,26 EUR	11.102.489 EUR	11,62 EUR
31. Dezember 2022	7.208.715 EUR	10,30 EUR	184.534.266 EUR	11,30 EUR	11.578.693 EUR	10,88 EUR
31. Dezember 2021	9.587.464 EUR	11,97 EUR	105.834.591 EUR	13,12 EUR	12.260.094 EUR	12,82 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR M NIW	Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR P NIW	Thesaurierende Klasse EUR P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR P NIW	Ausschüttende Klasse EUR P NIW je Anteil
31. Dezember 2023	3.338.833 EUR	7,80 EUR	8.972.769 EUR	10,65 EUR	19.262.572 EUR	9,41 EUR
31. Dezember 2022	3.553.082 EUR	7,61 EUR	37.115.535 EUR	9,84 EUR	4.537.698 EUR	9,02 EUR
31. Dezember 2021	5.282.983 EUR	9,33 EUR	172.678.924 EUR	11,46 EUR	9.906.904 EUR	10,84 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.291.998 GBP	11,58 GBP	1.749.168 GBP	11,42 GBP	24.129 GBP	9,64 GBP
31. Dezember 2022	5.461.763 GBP	10,54 GBP	10.032.613 GBP	10,38 GBP	406.601 GBP	9,09 GBP
31. Dezember 2021	7.515.008 GBP	12,08 GBP	65.235.151 GBP	11,88 GBP	2.229.096 GBP	10,76 GBP

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP P NIW	Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP P NIW	Ausschüttende Klasse GBP P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.523.093 GBP	10,42 GBP	6.890.614 GBP	9,32 GBP	1.755.818 SGD	16,40 SGD
31. Dezember 2022	6.021.069 GBP	9,48 GBP	7.470.246 GBP	8,78 GBP	1.412.307 SGD	16,07 SGD
31. Dezember 2021	7.982.111 GBP	10,86 GBP	5.490.392 GBP	10,40 GBP	2.442.580 SGD	19,43 SGD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	49.232.073 USD	8,49 USD	49.383.201 USD	12,27 USD	71.151 USD	8,99 USD
31. Dezember 2022	55.263.711 USD	8,26 USD	49.003.214 USD	11,18 USD	66.746 USD	8,44 USD
31. Dezember 2021	92.010.151 USD	9,96 USD	70.561.322 USD	12,82 USD	78.523 USD	9,93 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	3.418.540 USD	10,50 USD	47.532.250 USD	13,63 USD	980.224 USD	9,01 USD
31. Dezember 2022	5.909.890 USD	9,66 USD	54.193.798 USD	12,35 USD	1.406.325 USD	8,45 USD
31. Dezember 2021	9.625.219 USD	11,19 USD	222.206.104 USD	14,08 USD	1.303.331 USD	9,94 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	5.936.845 USD	12,74 USD	5.151.520 USD	10,31 USD	7.409.176 USD	10,76 USD
31. Dezember 2022	6.709.367 USD	11,52 USD	5.086.148 USD	9,68 USD	8.149.257 USD	9,86 USD
31. Dezember 2021	85.047.842 USD	13,12 USD	1.422.475 USD	11,39 USD	12.021.879 USD	11,38 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD P NIW	Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.046.883 USD	8,60 USD	7.705.875 USD	12,14 USD	443.619 USD	13,15 USD
31. Dezember 2022	2.213.713 USD	8,23 USD	15.462.358 USD	11,00 USD	399.396 USD	11,84 USD
31. Dezember 2021	2.946.315 USD	9,87 USD	67.895.964 USD	12,54 USD	224.418 USD	13,42 USD

Developed Market FMP – 2027[1]

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	699.973 EUR	10,31 EUR	308.247 EUR	10,38 EUR	69.482.815 USD	10,38 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A* NIW	Ausschüttende Klasse USD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I* NIW	Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	27.217.946 USD	10,38 USD	977.254 USD	10,40 USD	2.182.151 USD	10,48 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027[1] (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD X* NIW	Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD X* NIW	Ausschüttende Klasse USD X* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	35.874.119 USD	10,39 USD	873.350 USD	10,39 USD

Emerging Market Debt – Hard Currency

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD I NIW	Ausschüttende Klasse AUD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.943.558 AUD	7,08 AUD	23.198.262 AUD	8,31 AUD	52.703.579 CAD	12,26 CAD
31. Dezember 2022	2.134.881 AUD	6,88 AUD	21.672.088 AUD	7,81 AUD	47.479.252 CAD	11,04 CAD
31. Dezember 2021	3.086.824 AUD	9,17 AUD	31.429.849 AUD	10,32 AUD	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF P NIW	Thesaurierende Klasse CHF P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	134.304.949 CHF	8,45 CHF	25.327.791 CHF	8,51 CHF	7.633.978 EUR	6,33 EUR
31. Dezember 2022	161.496.077 CHF	7,73 CHF	21.658.399 CHF	7,79 CHF	7.363.041 EUR	6,20 EUR
31. Dezember 2021	50.748.457 CHF	9,80 CHF	35.834.088 CHF	9,89 CHF	10.607.100 EUR	8,36 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	51.163.108 EUR	10,53 EUR	89.529.420 EUR	11,46 EUR	17.230.269 EUR	9,70 EUR
31. Dezember 2022	32.580.202 EUR	9,53 EUR	118.505.956 EUR	10,31 EUR	17.296.623 EUR	8,82 EUR
31. Dezember 2021	30.854.130 EUR	12,16 EUR	346.351.970 EUR	13,06 EUR	1.141.580 EUR	10,22 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	175.147.404 EUR	6,86 EUR	45.795.061 EUR	8,77 EUR	36.308.806 EUR	7,36 EUR
31. Dezember 2022	178.942.116 EUR	6,49 EUR	61.386.430 EUR	7,87 EUR	32.976.153 EUR	6,96 EUR
31. Dezember 2021	267.762.991 EUR	8,68 EUR	100.699.618 EUR	9,96 EUR	40.279.528 EUR	9,32 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I3* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	68.995.700 EUR	9,84 EUR	–	–	–	–
31. Dezember 2022	101.186.993 EUR	8,83 EUR	29.023.972 EUR	8,76 EUR	–	–
31. Dezember 2021	112.230.449 EUR	11,16 EUR	39.028.171 EUR	10,12 EUR	2.658.043 EUR	9,44 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	44.153.327 EUR	11,13 EUR	89.770.039 EUR	11,04 EUR	525.911 EUR	9,81 EUR
31. Dezember 2022	106.621.915 EUR	9,97 EUR	68.627.475 EUR	10,00 EUR	625.349 EUR	8,95 EUR
31. Dezember 2021	172.221.503 EUR	12,60 EUR	–	–	880.261 EUR	11,51 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR M NIW	Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR P NIW	Thesaurierende Klasse EUR P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	138.890 EUR	6,36 EUR	10.477.004 EUR	8,88 EUR	551.473 EUR	9,27 EUR
31. Dezember 2022	136.677 EUR	6,16 EUR	9.665.588 EUR	7,98 EUR	298.344 EUR	8,27 EUR
31. Dezember 2021	234.678 EUR	8,44 EUR	42.731.452 EUR	10,11 EUR	375.373 EUR	10,41 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I NIW	Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	14.312.566 GBP	10,78 GBP	1.045.922 GBP	7,41 GBP	52.006.312 GBP	9,48 GBP
31. Dezember 2022	16.360.366 GBP	9,55 GBP	1.864.069 GBP	6,91 GBP	31.637.924 GBP	8,39 GBP
31. Dezember 2021	24.108.278 GBP	11,92 GBP	7.886.830 GBP	9,11 GBP	37.494.529 GBP	10,45 GBP

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P NIW	Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	14.500.268 GBP	7,71 GBP	6.285.375 GBP	9,67 GBP	1.470.947 HKD	7,64 HKD
31. Dezember 2022	11.800.925 GBP	7,18 GBP	7.543.092 GBP	8,56 GBP	1.259.413 HKD	7,38 HKD
31. Dezember 2021	17.959.384 GBP	9,47 GBP	6.433.590 GBP	10,68 GBP	2.284.462 HKD	9,73 HKD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse JPY I NIW	Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SEK A NIW	Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SEK I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse SEK I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.753.662.260 JPY	876,83 JPY	650.472.349 SEK	101,47 SEK	–	–
31. Dezember 2022	1.632.621.347 JPY	816,31 JPY	1.276.699.611 SEK	91,78 SEK	–	–
31. Dezember 2021	2.067.191.771 JPY	1.033,60 JPY	1.014.308.991 SEK	116,99 SEK	315.419 SEK	105,50 SEK

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SEK I2 NIW	Thesaurierende Klasse SEK I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	66.952.498 SEK	86,45 SEK	19.324.573 SGD	14,34 SGD	138.241.930 USD	7,21 USD
31. Dezember 2022	135.368.249 SEK	77,53 SEK	16.860.018 SGD	13,92 SGD	144.691.919 USD	6,89 USD
31. Dezember 2021	261.889.492 SEK	98,00 SEK	23.217.536 SGD	18,39 SGD	271.875.924 USD	9,06 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	120.778.298 USD	12,73 USD	377.098 USD	8,36 USD	9.941.291 USD	9,46 USD
31. Dezember 2022	112.403.688 USD	11,26 USD	42.552 USD	7,74 USD	10.176.824 USD	8,45 USD
31. Dezember 2021	167.936.528 USD	13,99 USD	24.437 USD	10,06 USD	15.072.281 USD	10,60 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	571.487.781 USD	13,71 USD	73.431.118 USD	8,32 USD	273.160.580 USD	11,91 USD
31. Dezember 2022	583.066.950 USD	12,04 USD	80.694.053 USD	7,70 USD	33.738.168 USD	10,45 USD
31. Dezember 2021	846.829.107 USD	14,86 USD	151.677.969 USD	10,02 USD	182.237.940 USD	12,87 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I3 NIW	Ausschüttende Klasse USD I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	19.503.916 USD	8,07 USD	88.359.188 USD	8,22 USD	17.071.508 USD	9,56 USD
31. Dezember 2022	13.108.552 USD	7,47 USD	81.371.873 USD	7,60 USD	16.134.339 USD	8,52 USD
31. Dezember 2021	28.105.309 USD	9,71 USD	103.575.521 USD	9,89 USD	23.509.954 USD	10,67 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD P NIW	Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil
31. Dezember 2023	3.623.006 USD	6,75 USD	62.007.224 USD	10,19 USD	112.274.225 USD	9,30 USD
31. Dezember 2022	3.112.446 USD	6,39 USD	17.590.354 USD	8,95 USD	98.360.925 USD	8,15 USD
31. Dezember 2021	4.183.182 USD	8,52 USD	30.611.343 USD	11,03 USD	25.072.481 USD	10,03 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	112.030 USD	11,49 USD
31. Dezember 2022	97.737 USD	10,02 USD
31. Dezember 2021	10.072.039 USD	12,27 USD

Emerging Market Debt – Local Currency

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD B NIW	Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.680.905 AUD	3,51 AUD	288.975 AUD	8,34 AUD	–	–
31. Dezember 2022	3.579.112 AUD	3,54 AUD	279.747 AUD	7,62 AUD	67.549 AUD	3,53 AUD
31. Dezember 2021	13.367.215 AUD	4,65 AUD	547.824 AUD	9,06 AUD	335.367 AUD	4,64 AUD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil
31. Dezember 2023	7.713 AUD	8,34 AUD	508.897 AUD	3,52 AUD	68.860 AUD	8,33 AUD
31. Dezember 2022	7.870 AUD	7,61 AUD	399.839 AUD	3,54 AUD	43.406 AUD	7,61 AUD
31. Dezember 2021	137.972 AUD	9,05 AUD	1.991.255 AUD	4,66 AUD	67.654 AUD	9,05 AUD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	25.930.999 AUD	3,82 AUD	2.144.666 AUD	9,07 AUD	1.976.819 EUR	7,19 EUR
31. Dezember 2022	27.559.985 AUD	3,81 AUD	2.188.886 AUD	8,21 AUD	2.710.862 EUR	6,52 EUR
31. Dezember 2021	35.067.739 AUD	4,97 AUD	2.587.589 AUD	9,66 AUD	25.996.331 EUR	7,75 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	26.979.998 EUR	7,76 EUR	160.972.265 EUR	10,15 EUR	15.466.180 EUR	11,97 EUR
31. Dezember 2022	12.677.170 EUR	6,99 EUR	153.261.974 EUR	9,22 EUR	13.077.476 EUR	10,86 EUR
31. Dezember 2021	30.265.508 EUR	8,25 EUR	192.874.499 EUR	9,93 EUR	35.836.407 EUR	11,69 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	19.486.748 EUR	7,57 EUR	–	–
31. Dezember 2022	–	–	18.536.988 EUR	7,20 EUR	–	–
31. Dezember 2021	10.292.044 EUR	8,91 EUR	20.906.428 EUR	8,12 EUR	238.538 EUR	7,13 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	78.895.093 EUR	10,18 EUR	371.999 GBP	8,63 GBP	80.057.410 GBP	10,42 GBP
31. Dezember 2022	79.014.824 EUR	9,22 EUR	71.487 GBP	7,65 GBP	55.720.554 GBP	9,67 GBP
31. Dezember 2021	97.240.658 EUR	9,89 EUR	79.233 GBP	8,89 GBP	91.993.396 GBP	9,83 GBP

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SEK A NIW	Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	40.220.459 GBP	7,40 GBP	37.033.049 GBP	9,95 GBP	7.555.579 SEK	88,68 SEK
31. Dezember 2022	34.761.741 GBP	7,20 GBP	51.131.054 GBP	9,22 GBP	8.262.545 SEK	80,46 SEK
31. Dezember 2021	81.473.761 GBP	7,69 GBP	115.816.857 GBP	9,36 GBP	10.695.289 SEK	95,54 SEK

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	715.536 SGD	11,03 SGD	3.826.624 USD	4,97 USD	13.576.056 USD	8,79 USD
31. Dezember 2022	431.283 SGD	10,66 SGD	2.763.181 USD	4,73 USD	13.383.059 USD	7,78 USD
31. Dezember 2021	649.455 SGD	13,26 SGD	6.244.240 USD	5,84 USD	18.460.479 USD	8,99 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD B NIW	Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	11.403.018 USD	4,02 USD	516.378 USD	8,91 USD	3.620 USD	4,02 USD
31. Dezember 2022	11.674.878 USD	3,97 USD	507.723 USD	7,99 USD	523.171 USD	3,97 USD
31. Dezember 2021	36.742.638 USD	5,14 USD	2.532.846 USD	9,36 USD	1.870.919 USD	5,14 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C2* NIW	Thesaurierende Klasse USD C2* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD E NIW	Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	1.731.121 USD	4,02 USD	259.037 USD	8,92 USD
31. Dezember 2022	22.894 USD	7,99 USD	3.285.216 USD	3,97 USD	313.230 USD	7,99 USD
31. Dezember 2021	96.102 USD	9,36 USD	8.118.705 USD	5,14 USD	785.843 USD	9,36 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	36.107.420 USD	7,97 USD	194.371.958 USD	9,52 USD	1.184.970 USD	7,55 USD
31. Dezember 2022	39.776.506 USD	7,52 USD	373.741.103 USD	8,36 USD	537.178 USD	6,94 USD
31. Dezember 2021	70.740.746 USD	9,23 USD	471.679.737 USD	9,60 USD	16.255.837 USD	8,34 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	70.501.757 USD	9,26 USD	16.123 USD	10,20 USD	51.105.062 USD	4,45 USD
31. Dezember 2022	54.407.790 USD	8,12 USD	18 USD	9,08 USD	48.894.990 USD	4,35 USD
31. Dezember 2021	87.839.639 USD	9,30 USD	21 USD	10,74 USD	57.094.005 USD	5,58 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Y NIW	Thesaurierende Klasse USD Y NIW je Anteil
31. Dezember 2023	4.366.661 USD	9,71 USD	142.192.091 USD	9,46 USD	158.436.161 USD	9,18 USD
31. Dezember 2022	4.066.572 USD	8,61 USD	141.579.673 USD	8,27 USD	154.229.779 USD	8,03 USD
31. Dezember 2021	3.643.090 USD	9,99 USD	158.320.032 USD	9,45 USD	185.351.561 USD	9,18 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	46.066.036 ZAR	36,52 ZAR	12.043.264 ZAR	123,28 ZAR	68.175 ZAR	36,53 ZAR
31. Dezember 2022	123.706.182 ZAR	36,58 ZAR	6.630.951 ZAR	107,97 ZAR	2.919.213 ZAR	36,57 ZAR
31. Dezember 2021	372.074.859 ZAR	47,97 ZAR	20.592.012 ZAR	122,85 ZAR	13.001.826 ZAR	47,95 ZAR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil
31. Dezember 2023	193.673 ZAR	121,37 ZAR	14.044.410 ZAR	36,52 ZAR	223.552 ZAR	123,23 ZAR
31. Dezember 2022	99.096 ZAR	107,97 ZAR	20.692.248 ZAR	36,58 ZAR	790.752 ZAR	107,98 ZAR
31. Dezember 2021	2.369.046 ZAR	122,83 ZAR	87.281.421 ZAR	47,96 ZAR	3.924.596 ZAR	122,85 ZAR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil
31. Dezember 2023	562.071.052 ZAR	39,80 ZAR	48.967.524 ZAR	134,35 ZAR
31. Dezember 2022	549.054.261 ZAR	39,47 ZAR	40.857.889 ZAR	116,49 ZAR
31. Dezember 2021	640.987.979 ZAR	51,24 ZAR	35.519.500 ZAR	131,23 ZAR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD I3 NIW	Ausschüttende Klasse AUD I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	8.072.686 AUD	7,96 AUD	10.852.194 EUR	10,46 EUR	239.809.262 EUR	10,81 EUR
31. Dezember 2022	8.275.300 AUD	7,49 AUD	10.503.424 EUR	9,66 EUR	206.919.548 EUR	9,92 EUR
31. Dezember 2021	7.443.128 AUD	8,87 AUD	8.159.335 EUR	11,09 EUR	289.180.614 EUR	11,31 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	23.015.364 EUR	7,22 EUR	13.866.675 EUR	11,12 EUR	8.681.343 EUR	7,03 EUR
31. Dezember 2022	24.719.131 EUR	6,93 EUR	19.433.459 EUR	10,19 EUR	9.667.380 EUR	6,74 EUR
31. Dezember 2021	39.783.115 EUR	8,29 EUR	39.777.757 EUR	11,60 EUR	19.021.300 EUR	8,07 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	37.124.103 EUR	7,83 EUR	1.921.897 EUR	10,67 EUR	20.761.167 EUR	11,77 EUR
31. Dezember 2022	22.443 EUR	7,48 EUR	579.587 EUR	9,81 EUR	21.116.810 EUR	10,76 EUR
31. Dezember 2021	26.733 EUR	8,91 EUR	542.937 EUR	10,69 EUR	28.115.162 EUR	12,22 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR M NIW	Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	523.183 EUR	10,02 EUR	1.045.469 EUR	5,99 EUR	153.104 EUR	11,70 EUR
31. Dezember 2022	497.438 EUR	9,32 EUR	241.149 EUR	6,05 EUR	101.072 EUR	10,65 EUR
31. Dezember 2021	692.926 EUR	10,79 EUR	526.771 EUR	7,54 EUR	114.450 EUR	12,06 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I NIW	Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	447.473 GBP	11,57 GBP	5.642 GBP	10,53 GBP	9.742.793 GBP	8,05 GBP
31. Dezember 2022	350.186 GBP	10,65 GBP	5.345 GBP	9,93 GBP	11.265.349 GBP	7,75 GBP
31. Dezember 2021	560.031 GBP	11,71 GBP	81.741.756 GBP	10,26 GBP	19.053.387 GBP	8,95 GBP

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P NIW	Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	572.809 GBP	8,49 GBP	3.109.393 GBP	10,14 GBP	925.166 GBP	10,44 GBP
31. Dezember 2022	560.698 GBP	8,39 GBP	6.745.122 GBP	9,33 GBP	962.313 GBP	9,85 GBP
31. Dezember 2021	615.334 GBP	9,09 GBP	68.691.789 GBP	10,26 GBP	1.227.759 GBP	10,18 GBP

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse NOK U NIW	Thesaurierende Klasse NOK U NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SEK A NIW	Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	213.173 GBP	12,62 GBP	256.896 NOK	112,39 NOK	26.654.232 SEK	112,47 SEK
31. Dezember 2022	194.796 GBP	11,54 GBP	228.017 NOK	99,75 NOK	27.339.928 SEK	103,59 SEK
31. Dezember 2021	212.772 GBP	12,60 GBP	252.567 NOK	110,49 NOK	29.175.467 SEK	114,14 SEK

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	4.180.476 SGD	12,67 SGD	329.767 USD	6,55 USD	6.722.677 USD	11,69 USD
31. Dezember 2022	4.038.162 SGD	12,31 SGD	342.321 USD	6,26 USD	10.292.897 USD	10,49 USD
31. Dezember 2021	5.096.662 SGD	15,39 SGD	479.450 USD	7,79 USD	13.236.655 USD	12,29 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	826.659 USD	9,08 USD	16.801.138 USD	11,06 USD	379.773 USD	8,25 USD
31. Dezember 2022	1.059.311 USD	8,23 USD	27.687.499 USD	9,85 USD	417.314 USD	7,69 USD
31. Dezember 2021	1.352.420 USD	9,74 USD	95.215.396 USD	11,47 USD	1.720.755 USD	9,38 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I3* NIW	Thesaurierende Klasse USD I3* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	40.972.944 USD	7,57 USD	–	–
31. Dezember 2022	–	–	38.999.171 USD	7,05 USD	41.113.489 USD	8,98 USD
31. Dezember 2021	10.439 USD	12,18 USD	56.056.559 USD	8,61 USD	47.739.922 USD	10,43 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	33.920.715 USD	10,40 USD	731.356 USD	9,16 USD	572.534 USD	6,06 USD
31. Dezember 2022	–	–	737.778 USD	8,29 USD	486.413 USD	5,94 USD
31. Dezember 2021	–	–	1.152.835 USD	9,79 USD	555.953 USD	7,56 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	125.103 USD	13,23 USD
31. Dezember 2022	110.712 USD	11,70 USD
31. Dezember 2021	143.969 USD	13,52 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD I2 NIW	Thesaurierende Klasse AUD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse NOK I NIW	Thesaurierende Klasse NOK I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse NOK I3* NIW	Thesaurierende Klasse NOK I3* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	23.549.524 AUD	9,29 AUD	3.209.047 NOK	111,71 NOK	379.560.196 NOK	103,13 NOK
31. Dezember 2022	21.961.420 AUD	8,67 AUD	297.517.124 NOK	103,11 NOK	–	–
31. Dezember 2021	25.150.120 AUD	9,93 AUD	151.079.339 NOK	116,42 NOK	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	41.218 USD	11,20 USD	4.388.707 USD	9,34 USD	6.869.103 USD	11,26 USD
31. Dezember 2022	38.055 USD	10,34 USD	4.047.197 USD	8,61 USD	5.087.444 USD	10,33 USD
31. Dezember 2021	3.064.011 USD	12,07 USD	4.719.304 USD	10,04 USD	4.184.553 USD	11,99 USD

Emerging Markets Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD B NIW	Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil
31. Dezember 2023	275.609 AUD	9,42 AUD	14.841 AUD	9,43 AUD	42.510 AUD	9,41 AUD
31. Dezember 2022	389.876 AUD	9,13 AUD	11.442 AUD	9,13 AUD	125.310 AUD	9,12 AUD
31. Dezember 2021	973.288 AUD	12,57 AUD	86.974 AUD	12,57 AUD	149.325 AUD	12,56 AUD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CAD I2 NIW	Ausschüttende Klasse CAD I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.771.385 AUD	10,11 AUD	66.826 CAD	8,07 CAD	11.897.241 CAD	7,97 CAD
31. Dezember 2022	1.741.416 AUD	9,69 AUD	65.215 CAD	7,87 CAD	11.406.458 CAD	7,64 CAD
31. Dezember 2021	2.482.029 AUD	13,22 AUD	99.440 CAD	9,67 CAD	15.162.299 CAD	10,16 CAD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	709.680 EUR	9,04 EUR	408.164 EUR	10,17 EUR	173.388 EUR	7,78 EUR
31. Dezember 2022	1.362.334 EUR	8,60 EUR	429.393 EUR	9,87 EUR	163.271 EUR	7,33 EUR
31. Dezember 2021	4.453.674 EUR	11,68 EUR	638.237 EUR	13,67 EUR	219.436 EUR	9,85 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I* NIW	Thesaurierende Klasse JPY I* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	406.653 GBP	10,43 GBP	86.537 GBP	12,65 GBP	–	–
31. Dezember 2022	381.404 GBP	9,77 GBP	80.198 GBP	11,72 GBP	–	–
31. Dezember 2021	507.319 GBP	13,06 GBP	276.830 GBP	15,52 GBP	2.269.318.913 JPY	1.932,31 JPY

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD B NIW	Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	5.239.268 USD	10,08 USD	856.399 USD	10,52 USD	10.153 USD	10,50 USD
31. Dezember 2022	4.825.592 USD	9,44 USD	1.423.437 USD	9,96 USD	119.565 USD	9,95 USD
31. Dezember 2021	5.958.601 USD	12,53 USD	4.387.042 USD	13,34 USD	441.938 USD	13,33 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD E NIW	Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	138.219 USD	10,50 USD	41.804.429 USD	11,48 USD	439.380 USD	11,20 USD
31. Dezember 2022	265.455 USD	9,94 USD	155.175.902 USD	10,66 USD	398.316 USD	10,60 USD
31. Dezember 2021	259.510 USD	13,33 USD	215.496.124 USD	14,00 USD	87.899.018 USD	14,21 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil
31. Dezember 2023	4.026.797 USD	11,29 USD	23.862.482 USD	11,91 USD	4.948.769 ZAR	131,03 ZAR
31. Dezember 2022	6.120.100 USD	10,57 USD	11.172.939 USD	10,94 USD	6.247.098 ZAR	121,51 ZAR
31. Dezember 2021	5.000.441 USD	14,04 USD	24.331.753 USD	14,23 USD	14.496.527 ZAR	159,43 ZAR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil
31. Dezember 2023	47.220 ZAR	131,00 ZAR	3.798.941 ZAR	131,02 ZAR	23.945.169 ZAR	140,86 ZAR
31. Dezember 2022	1.133.518 ZAR	121,50 ZAR	3.953.205 ZAR	121,51 ZAR	24.141.495 ZAR	129,33 ZAR
31. Dezember 2021	3.248.033 ZAR	159,42 ZAR	7.038.741 ZAR	159,43 ZAR	27.707.879 ZAR	168,00 ZAR

Emerging Markets Select Equity**

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2022	2.008.452 EUR	8,70 EUR	1.269.919.529 JPY	1.112,95 JPY	81.907.316 USD	8,84 USD
31. Dezember 2021	3.415.822 EUR	10,88 EUR	1.481.186.443 JPY	1.294,74 JPY	108.356.432 USD	11,79 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I* NIW	Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	–	–
31. Dezember 2022	–	–	68.263 USD	8,53 USD
31. Dezember 2021	33.280 USD	11,55 USD	180.706 USD	11,33 USD

** Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Euro Bond

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	653.118 EUR	10,95 EUR	9.919.526 EUR	10,13 EUR
31. Dezember 2022	78.692 EUR	9,96 EUR	9.215.906 EUR	9,41 EUR
31. Dezember 2021	35.402 EUR	11,80 EUR	11.176.195 EUR	11,42 EUR

Euro Bond Absolute Return

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.020.367 EUR	11,38 EUR	9.922 EUR	10,67 EUR	5.531.035 EUR	11,43 EUR
31. Dezember 2022	2.262.829 EUR	10,52 EUR	13.827.199 EUR	10,04 EUR	18.661.626 EUR	10,55 EUR
31. Dezember 2021	4.281.372 EUR	11,04 EUR	14.785.620 EUR	10,73 EUR	21.860.412 EUR	11,04 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	30.372.279 USD	12,04 USD
31. Dezember 2022	14.615.873 USD	10,86 USD
31. Dezember 2021	14.601.349 USD	11,11 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.796.679 CHF	10,75 CHF	47.206.772 EUR	14,01 EUR	208.432 EUR	10,54 EUR
31. Dezember 2022	–	–	875.869 EUR	12,34 EUR	–	–
31. Dezember 2021	–	–	804.681 EUR	13,64 EUR	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR X NIW	Thesaurierende Klasse EUR X NIW je Anteil
31. Dezember 2023	6.258.149 EUR	10,44 EUR	787.345 EUR	12,68 EUR	48.934.376 EUR	12,33 EUR
31. Dezember 2022	–	–	524.711 EUR	11,31 EUR	5.239.330 EUR	10,82 EUR
31. Dezember 2021	–	–	468.144 EUR	12,65 EUR	5.714.467 EUR	11,91 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR Y* NIW	Thesaurierende Klasse EUR Y* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR Y* NIW	Ausschüttende Klasse EUR Y* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	281.409.669 EUR	11,30 EUR	2.941.098 EUR	10,74 EUR	–	–
31. Dezember 2022	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2021	–	–	–	–	69.111 SGD	19,86 SGD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil
31. Dezember 2023	320.629 USD	9,25 USD	228.440 USD	16,49 USD	585.996 USD	13,90 USD
31. Dezember 2022	343.199 USD	8,63 USD	14.858.536 USD	14,23 USD	2.659.377 USD	11,95 USD
31. Dezember 2021	1.595.734 USD	9,97 USD	16.063.101 USD	15,39 USD	8.129.396 USD	12,87 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	19.509.577 USD	13,11 USD
31. Dezember 2022	9.687.331 USD	11,25 USD
31. Dezember 2021	10.412.554 USD	12,09 USD

European Sustainable Equity

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR A* NIW	Ausschüttende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	24.542 EUR	9,34 EUR	34.572 EUR	10,84 EUR	11.039 EUR	10,75 EUR
31. Dezember 2022	20.816 EUR	7,93 EUR	29.063 EUR	9,11 EUR	3.727.608 EUR	9,09 EUR
31. Dezember 2021	–	–	36.335 EUR	12,14 EUR	43.048.066 EUR	12,15 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	112.925.635 EUR	9,21 EUR	2.081.086 EUR	9,49 EUR	39.633 EUR	10,33 EUR
31. Dezember 2022	126.435.303 EUR	7,79 EUR	1.690.128 EUR	7,96 EUR	21.161 EUR	8,83 EUR
31. Dezember 2021	48.257.250 EUR	10,37 EUR	2.114.337 EUR	10,57 EUR	28.683 EUR	11,97 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	56.967.179 EUR	10,92 EUR	9.798 USD	9,80 USD	10.041 USD	10,04 USD
31. Dezember 2022	28.841.630 EUR	9,12 EUR	8.028 USD	8,03 USD	16.077.887 USD	8,15 USD
31. Dezember 2021	321.015 EUR	12,09 EUR	11.498 USD	11,50 USD	22.830.455 USD	11,58 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	9.581 USD	9,58 USD
31. Dezember 2022	7.914 USD	7,91 USD
31. Dezember 2021	11.426 USD	11,43 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Event Driven[2]

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I5* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	9.507 EUR	10,31 EUR	75.985.117 GBP	10,54 GBP	12.132.056 GBP	10,55 GBP
31. Dezember 2022	–	–	23.956.881 GBP	10,11 GBP	26.138 GBP	10,11 GBP

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP P* NIW	Thesaurierende Klasse GBP P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	27.125 GBP	10,50 GBP	10.548 USD	10,55 USD	13.846.477 USD	10,61 USD
31. Dezember 2022	26.104 GBP	10,10 GBP	10.126.565 USD	10,12 USD	2.455.025 USD	10,13 USD

Global Bond

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	29.629 AUD	7,53 AUD	28.777 EUR	10,40 EUR	340.537 USD	9,02 USD
31. Dezember 2022	29.300 AUD	7,44 AUD	–	–	414.949 USD	8,57 USD
31. Dezember 2021	36.285 AUD	9,22 AUD	–	–	646.469 USD	10,29 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse* NIW	Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	32.939 USD	10,98 USD	3.215.877 USD	10,26 USD	420.409 USD	9,54 USD
31. Dezember 2022	30.527 USD	10,18 USD	1.427.481 USD	9,63 USD	255.883 USD	9,00 USD
31. Dezember 2021	–	–	1.692.881 USD	11,42 USD	767.170 USD	10,76 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	23.698 USD	7,90 USD	104.673.682 USD	10,79 USD	345.130 ZAR	77,03 ZAR
31. Dezember 2022	23.014 USD	7,67 USD	132.650.317 USD	10,10 USD	338.271 ZAR	75,50 ZAR
31. Dezember 2021	28.145 USD	9,38 USD	177.197.847 USD	11,94 USD	416.008 ZAR	92,85 ZAR

Global Diversified Income FMP – 2024

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR A NIW	Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.220.917 EUR	9,99 EUR	223.121 EUR	8,92 EUR	881.687 EUR	8,82 EUR
31. Dezember 2022	1.182.222 EUR	9,67 EUR	223.454 EUR	8,94 EUR	882.969 EUR	8,83 EUR
31. Dezember 2021	1.262.238 EUR	10,33 EUR	247.602 EUR	9,90 EUR	978.540 EUR	9,79 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I NIW	Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse HKD A NIW	Ausschüttende Klasse HKD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A NIW	Ausschüttende Klasse SGD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.906.267 GBP	9,30 GBP	6.877.059 HKD	9,17 HKD	4.402.150 SGD	18,52 SGD
31. Dezember 2022	1.968.485 GBP	9,16 GBP	6.811.671 HKD	9,08 HKD	4.834.873 SGD	18,40 SGD
31. Dezember 2021	2.146.117 GBP	9,99 GBP	7.426.965 HKD	9,90 HKD	5.454.504 SGD	20,00 SGD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	27.345.677 USD	10,56 USD	37.856.568 USD	9,40 USD	2.714.197 USD	10,70 USD
31. Dezember 2022	29.538.472 USD	10,01 USD	42.245.620 USD	9,23 USD	2.564.036 USD	10,11 USD
31. Dezember 2021	35.468.827 USD	10,47 USD	50.998.594 USD	10,00 USD	4.002.526 USD	10,53 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD X NIW	Ausschüttende Klasse USD X NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.108.874 USD	9,41 USD	22.493.910 USD	10,69 USD	54.424.599 USD	9,41 USD
31. Dezember 2022	2.069.152 USD	9,23 USD	21.260.082 USD	10,10 USD	53.399.383 USD	9,24 USD
31. Dezember 2021	2.441.459 USD	10,01 USD	22.155.921 USD	10,53 USD	107.962.161 USD	10,01 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	7.537.600 EUR	9,95 EUR	7.793.561 EUR	15,99 EUR	8.355 GBP	10,63 GBP
31. Dezember 2022	–	–	5.374.723 EUR	13,68 EUR	–	–
31. Dezember 2021	–	–	2.781.561 EUR	15,15 EUR	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SGD A* NIW	Thesaurierende Klasse SGD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	41.911 SGD	20,85 SGD	43.806.365 USD	15,15 USD	3.687.503 USD	14,33 USD
31. Dezember 2022	–	–	33.770.046 USD	12,43 USD	3.586.666 USD	11,87 USD
31. Dezember 2021	–	–	33.387.264 USD	14,54 USD	4.271.651 USD	14,03 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	35.156.723 USD	15,99 USD	21.892.795 USD	14,39 USD	22.954.011 USD	10,87 USD
31. Dezember 2022	9.729.597 USD	13,01 USD	17.646.556 USD	11,90 USD	8.879.110 USD	8,77 USD
31. Dezember 2021	19.765.635 USD	15,09 USD	22.544.188 USD	14,04 USD	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CAD I5 NIW	Thesaurierende Klasse CAD I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	14.626.794 CAD	10,47 CAD	5.816.508 EUR	10,66 EUR	445.491 EUR	10,05 EUR
31. Dezember 2022	14.013.104 CAD	9,34 CAD	3.643.959 EUR	9,69 EUR	390.568 EUR	9,25 EUR
31. Dezember 2021	15.582.329 CAD	10,39 CAD	3.296.205 EUR	11,01 EUR	411.798 EUR	10,67 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	151.941.174 GBP	11,76 GBP	9.962.495 USD	10,89 USD	157.808.987 USD	11,86 USD
31. Dezember 2022	196.137.415 GBP	10,49 GBP	9.127.970 USD	9,74 USD	123.697.450 USD	10,54 USD
31. Dezember 2021	386.920.465 GBP	11,70 GBP	10.681.489 USD	10,88 USD	136.359.008 USD	11,70 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	355.209 USD	10,15 USD	6.408.215 USD	10,60 USD	6.004.606 USD	12,11 USD
31. Dezember 2022	333.308 USD	9,53 USD	5.552.804 USD	9,56 USD	5.191.915 USD	10,70 USD
31. Dezember 2021	432.340 USD	11,09 USD	6.153.911 USD	10,76 USD	10.994.680 USD	11,81 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global SDG Engagement

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD I* NIW	Ausschüttende Klasse AUD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I4* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I4* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CHF I4* NIW	Ausschüttende Klasse CHF I4* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	40.737 AUD	9,65 AUD	74.837.938 CHF	10,11 CHF	4.796.137 CHF	9,36 CHF
31. Dezember 2022	39.517 AUD	9,36 AUD	34.903.208 CHF	9,53 CHF	2.109.781 CHF	9,32 CHF

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF X* NIW	Thesaurierende Klasse CHF X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I4* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I4* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	29.298 CHF	10,00 CHF	64.352.654 EUR	10,29 EUR	1.101.288 EUR	9,52 EUR
31. Dezember 2022	27.818 CHF	9,49 CHF	34.350.965 EUR	9,51 EUR	894.723 EUR	9,30 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	28.912 EUR	10,16 EUR	23.929.260 EUR	11,58 EUR	18.172.947 GBP	10,59 GBP
31. Dezember 2022	26.930 EUR	9,46 EUR	21.835.394 EUR	10,68 EUR	8.029.261 GBP	9,63 GBP
31. Dezember 2021	–	–	24.099.127 EUR	12,25 EUR	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global SDG Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP X* NIW	Thesaurierende Klasse GBP X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	25.092 GBP	10,46 GBP	621.460 USD	12,38 USD	5.429.150 USD	13,08 USD
31. Dezember 2022	23.001 GBP	9,59 GBP	600.599 USD	11,29 USD	82.906 USD	11,86 USD
31. Dezember 2021	–	–	878.851 USD	12,78 USD	127.787 USD	13,35 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I4* NIW	Thesaurierende Klasse USD I4* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil
31. Dezember 2023	325.223.085 USD	10,73 USD	1.251.730 USD	7,92 USD	21.053 USD	10,46 USD
31. Dezember 2022	93.240.963 USD	9,70 USD	1.212.483 USD	7,72 USD	19.180 USD	9,53 USD
31. Dezember 2021	–	–	2.149.362 USD	9,32 USD	10.756 USD	10,76 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	8.991.111 USD	13,68 USD
31. Dezember 2022	8.101.529 USD	12,32 USD
31. Dezember 2021	9.055.187 USD	13,79 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global High Yield Sustainable Action**

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I* NIW	Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X* NIW	Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2022	9.396 USD	9,40 USD	12.286.350 USD	8,43 USD	9.281 USD	9,28 USD
31. Dezember 2021	10.624 USD	10,62 USD	14.496.421 USD	9,94 USD	10.453 USD	10,45 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Y* NIW	Thesaurierende Klasse USD Y* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–
31. Dezember 2022	2.739.164 USD	9,13 USD
31. Dezember 2021	3.084.210 USD	10,28 USD

** Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil
31. Dezember 2023	28.687 EUR	10,51 EUR	1.777.609 USD	9,25 USD	40.267.522 USD	9,29 USD
31. Dezember 2022	–	–	1.224.588 USD	8,44 USD	42.337.788 USD	8,46 USD
31. Dezember 2021	–	–	9.876 USD	9,88 USD	49.426.204 USD	9,88 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	44.688.102 USD	9,31 USD
31. Dezember 2022	42.354.407 USD	8,47 USD
31. Dezember 2021	49.408.813 USD	9,89 USD

Global Opportunistic Bond

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P NIW	Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	14.805 EUR	9,68 EUR	22.561 GBP	9,83 GBP	20.869 USD	10,83 USD
31. Dezember 2022	8.432.665 EUR	8,72 EUR	21.356 GBP	9,31 GBP	481.764 USD	10,22 USD
31. Dezember 2021	4.580.004 EUR	10,08 EUR	24.292 GBP	10,59 GBP	764.522 USD	11,59 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	4.553.699 USD	11,59 USD	12.262.296 USD	9,80 USD	23.293.272 USD	10,97 USD
31. Dezember 2022	4.135.327 USD	10,91 USD	8.952.587 USD	9,50 USD	24.678.158 USD	10,32 USD
31. Dezember 2021	13.048.644 USD	12,32 USD	10.384.711 USD	11,02 USD	26.442.006 USD	11,65 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	25.233.838 USD	10,70 USD
31. Dezember 2022	–	–	28.817.657 USD	10,04 USD
31. Dezember 2021	883.229 USD	10,56 USD	37.475.394 USD	11,31 USD

Global Real Estate Securities

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	877.918 EUR	10,17 EUR	213.904 EUR	11,79 EUR
31. Dezember 2022	9.028.171 EUR	7,69 EUR	1.021.424 EUR	9,87 EUR	103.583 EUR	11,25 EUR
31. Dezember 2021	8.785.756 EUR	10,86 EUR	1.405.014 EUR	13,96 EUR	119.721 EUR	14,07 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD CI NIW	Thesaurierende Klasse USD CI NIW je Anteil
31. Dezember 2023	89.203 GBP	12,21 GBP	3.456.439 USD	10,51 USD	135.797 USD	9,28 USD
31. Dezember 2022	83.075 GBP	11,37 GBP	4.298.698 USD	9,83 USD	128.352 USD	8,77 USD
31. Dezember 2021	108.494 GBP	15,48 GBP	6.500.961 USD	13,30 USD	212.935 USD	11,98 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I5 NIW	Ausschüttende Klasse USD I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	12.394.725 USD	13,51 USD	30.861 USD	9,31 USD	718.797 USD	9,51 USD
31. Dezember 2022	16.657.145 USD	12,55 USD	2.824.490 USD	8,82 USD	672.248 USD	8,99 USD
31. Dezember 2021	20.434.205 USD	16,86 USD	3.851.557 USD	12,03 USD	1.977.571 USD	12,29 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.419.204 USD	13,89 USD
31. Dezember 2022	3.549.409 USD	12,81 USD
31. Dezember 2021	6.105.329 USD	17,07 USD

Global Sustainable Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	86.892.096 EUR	12,11 EUR	78.678 EUR	11,43 EUR	1.439.413 EUR	11,72 EUR
31. Dezember 2022	79.067.463 EUR	10,10 EUR	59.173 EUR	9,73 EUR	1.214.656 EUR	9,75 EUR
31. Dezember 2021	111.148.483 EUR	13,18 EUR	65.402 EUR	12,96 EUR	1.610.088 EUR	12,68 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	981.020 GBP	11,49 GBP	4.420.169 GBP	11,59 GBP	471.447 USD	8,92 USD
31. Dezember 2022	526.524 GBP	9,85 GBP	4.009.524 GBP	9,90 GBP	523.329 USD	7,28 USD
31. Dezember 2021	8.807 GBP	12,20 GBP	8.837 GBP	12,22 GBP	39.703 USD	10,24 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	11.121.650 USD	10,93 USD	12.373 USD	10,94 USD	417.625 USD	10,38 USD
31. Dezember 2022	10.623.061 USD	8,83 USD	4.393.504 USD	8,84 USD	361.394 USD	8,54 USD
31. Dezember 2021	24.053.208 USD	12,33 USD	34.904.983 USD	12,33 USD	16.681.154 USD	12,10 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	37.957.449 USD	10,35 USD
31. Dezember 2022	24.466.171 USD	8,32 USD
31. Dezember 2021	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	520.510 EUR	15,76 EUR	10.307 GBP	11,12 GBP	8.811 GBP	10,70 GBP
31. Dezember 2022	483.610 EUR	14,02 EUR	9.338 GBP	10,08 GBP	–	–
31. Dezember 2021	628.122 EUR	16,86 EUR	–	–	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I3* NIW	Thesaurierende Klasse USD I3* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.388.066 USD	18,39 USD	10.479.115 USD	19,50 USD	31.008.928 USD	11,06 USD
31. Dezember 2022	2.093.493 USD	15,83 USD	2.989.730 USD	16,71 USD	23.813.624 USD	9,47 USD
31. Dezember 2021	1.133.453 USD	18,26 USD	296.605 USD	19,19 USD	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	11.985.820 USD	21,28 USD
31. Dezember 2022	19.288.532 USD	18,15 USD
31. Dezember 2021	18.743.661 USD	20,75 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD A NIW	Thesaurierende Klasse AUD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	15.862.650 AUD	6,50 AUD	2.858.210 AUD	15,00 AUD	10.373.440 AUD	4,93 AUD
31. Dezember 2022	18.826.339 AUD	6,43 AUD	3.345.436 AUD	13,78 AUD	14.918.035 AUD	4,95 AUD
31. Dezember 2021	25.718.582 AUD	7,91 AUD	5.613.157 AUD	15,93 AUD	28.237.139 AUD	6,24 AUD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD B NIW	Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.011.221 AUD	9,33 AUD	3.241 AUD	4,94 AUD	1.845.729 AUD	4,97 AUD
31. Dezember 2022	907.067 AUD	8,71 AUD	422.009 AUD	4,96 AUD	961.233 AUD	5,00 AUD
31. Dezember 2021	1.558.874 AUD	10,24 AUD	1.062.589 AUD	6,25 AUD	2.851.099 AUD	6,30 AUD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD I NIW	Ausschüttende Klasse AUD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	413.416 AUD	10,52 AUD	17.014.854 AUD	9,44 AUD	73.324.379 AUD	5,74 AUD
31. Dezember 2022	394.034 AUD	9,82 AUD	24.632.173 AUD	9,15 AUD	77.779.276 AUD	5,71 AUD
31. Dezember 2021	2.148.334 AUD	11,54 AUD	68.318.695 AUD	11,10 AUD	103.756.407 AUD	7,13 AUD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	754.803 AUD	5,55 AUD	1.527.094 AUD	12,80 AUD	5.981.498 CAD	6,74 CAD
31. Dezember 2022	790.496 AUD	5,52 AUD	2.009.139 AUD	11,83 AUD	6.486.618 CAD	6,61 CAD
31. Dezember 2021	1.233.271 AUD	6,89 AUD	1.334.710 AUD	13,75 AUD	10.968.503 CAD	8,06 CAD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF A NIW	Thesaurierende Klasse CHF A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I NIW	Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.903.144 CHF	12,18 CHF	220.795 CHF	13,06 CHF	2.436.116 CHF	11,20 CHF
31. Dezember 2022	3.669.718 CHF	11,47 CHF	5.277.144 CHF	12,22 CHF	1.843.440 CHF	10,47 CHF
31. Dezember 2021	5.323.617 CHF	13,46 CHF	678.236 CHF	14,25 CHF	2.608.938 CHF	12,20 CHF

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	11.540.823 CNY	73,18 CNY	208.678 CNY	77,78 CNY	5.784.669 EUR	6,06 EUR
31. Dezember 2022	14.058.980 CNY	73,25 CNY	207.631 CNY	77,39 CNY	6.420.394 EUR	6,03 EUR
31. Dezember 2021	18.648.136 CNY	89,36 CNY	17.018.798 CNY	93,83 CNY	10.909.966 EUR	7,53 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR A NIW	Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	5.575.031 EUR	19,94 EUR	2.533.501 EUR	7,19 EUR	18.413.969 EUR	17,76 EUR
31. Dezember 2022	20.497.963 EUR	18,42 EUR	2.934.472 EUR	7,01 EUR	21.263.684 EUR	16,30 EUR
31. Dezember 2021	29.425.571 EUR	21,61 EUR	3.944.868 EUR	8,62 EUR	23.795.414 EUR	19,02 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	4.310.197 EUR	6,92 EUR	51.114.447 EUR	12,47 EUR	56.865.932 EUR	6,82 EUR
31. Dezember 2022	5.068.640 EUR	6,74 EUR	21.766.293 EUR	11,44 EUR	37.930.088 EUR	6,65 EUR
31. Dezember 2021	12.460.480 EUR	8,30 EUR	19.114.240 EUR	13,33 EUR	1.155.752 EUR	8,19 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	34.119 EUR	11,15 EUR	181.078 EUR	11,90 EUR
31. Dezember 2022	–	–	40.548 EUR	10,36 EUR	165.274 EUR	10,87 EUR
31. Dezember 2021	178.350.768 EUR	10,72 EUR	36.027 EUR	12,23 EUR	191.608 EUR	12,60 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP A NIW	Thesaurierende Klasse GBP A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP A NIW	Ausschüttende Klasse GBP A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.684.037 GBP	6,34 GBP	1.411.301 GBP	14,20 GBP	954.452 GBP	7,91 GBP
31. Dezember 2022	2.614.675 GBP	6,20 GBP	1.624.325 GBP	12,91 GBP	1.085.076 GBP	7,59 GBP
31. Dezember 2021	5.971.923 GBP	7,60 GBP	1.923.551 GBP	14,87 GBP	1.639.261 GBP	9,18 GBP

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I NIW	Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	5.789.389 GBP	17,29 GBP	3.395.941 GBP	8,55 GBP	1.512.133 GBP	13,84 GBP
31. Dezember 2022	5.660.368 GBP	15,62 GBP	7.234.066 GBP	8,21 GBP	581.131 GBP	12,49 GBP
31. Dezember 2021	6.489.882 GBP	17,89 GBP	16.481.165 GBP	9,93 GBP	754.148 GBP	14,29 GBP

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	168.547.845 GBP	7,57 GBP	124.386 GBP	13,42 GBP	36.563.065 HKD	6,65 HKD
31. Dezember 2022	123.006.920 GBP	7,27 GBP	153.131 GBP	12,06 GBP	38.478.810 HKD	6,53 HKD
31. Dezember 2021	28.016.548 GBP	8,79 GBP	91.103 GBP	13,72 GBP	50.388.746 HKD	7,97 HKD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SEK A NIW	Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	723.938.325 SEK	136,03 SEK	19.027.580 SGD	13,83 SGD	4.897.409 SGD	29,01 SGD
31. Dezember 2022	78.792.625 SEK	125,59 SEK	22.367.741 SGD	13,65 SGD	2.875.654 SGD	26,58 SGD
31. Dezember 2021	101.874.300 SEK	146,45 SEK	32.504.626 SGD	16,64 SGD	3.883.139 SGD	30,46 SGD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	77.008.320 USD	7,13 USD	2.412.509 USD	6,84 USD	131.648.685 USD	18,07 USD
31. Dezember 2022	93.381.210 USD	6,93 USD	2.844.055 USD	6,65 USD	137.066.692 USD	16,32 USD
31. Dezember 2021	160.083.379 USD	8,42 USD	2.280.972 USD	8,07 USD	201.215.637 USD	18,63 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD B NIW	Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil
31. Dezember 2023	19.236.817 USD	8,60 USD	98.121.371 USD	5,45 USD	9.209.516 USD	11,85 USD
31. Dezember 2022	20.742.314 USD	8,20 USD	111.013.457 USD	5,38 USD	12.754.653 USD	10,88 USD
31. Dezember 2021	35.473.177 USD	9,80 USD	173.623.426 USD	6,70 USD	20.260.951 USD	12,61 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C NIW	Thesaurierende Klasse USD C NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD C1 NIW	Ausschüttende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	920.256 USD	13,28 USD	2.325.248 USD	10,80 USD	595.052 USD	8,69 USD
31. Dezember 2022	894.416 USD	12,07 USD	2.598.086 USD	9,85 USD	612.205 USD	8,29 USD
31. Dezember 2021	1.176.654 USD	13,86 USD	3.629.287 USD	11,36 USD	885.749 USD	9,90 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	12.549 USD	5,44 USD	6.358 USD	11,86 USD	10.460.452 USD	5,53 USD
31. Dezember 2022	3.605.063 USD	5,38 USD	2.346.023 USD	10,89 USD	11.744.149 USD	5,46 USD
31. Dezember 2021	8.209.587 USD	6,70 USD	3.518.498 USD	12,63 USD	19.267.884 USD	6,79 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD E NIW	Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.547.421 USD	10,69 USD	39.896.230 USD	7,45 USD	301.321.511 USD	27,54 USD
31. Dezember 2022	2.696.286 USD	9,81 USD	56.976.570 USD	7,20 USD	420.046.688 USD	24,73 USD
31. Dezember 2021	3.591.490 USD	11,38 USD	96.952.330 USD	8,69 USD	491.357.430 USD	28,05 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	16.191.311 USD	9,94 USD	55.183.017 USD	8,38 USD	224.394.250 USD	15,08 USD
31. Dezember 2022	19.820.534 USD	9,48 USD	53.570.112 USD	8,09 USD	265.106.976 USD	13,53 USD
31. Dezember 2021	50.607.421 USD	11,34 USD	71.642.859 USD	9,76 USD	421.521.968 USD	15,33 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	220.847.493 USD	8,30 USD	140.373.282 USD	9,42 USD	460.538 USD	13,34 USD
31. Dezember 2022	156.239.569 USD	7,91 USD	124.143.845 USD	8,88 USD	553.297 USD	12,12 USD
31. Dezember 2021	101.965.510 USD	9,46 USD	190.867.412 USD	10,56 USD	685.349 USD	13,92 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD P NIW	Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	347.894 USD	8,01 USD	1.839.803 USD	11,89 USD	133.819.218 USD	6,08 USD
31. Dezember 2022	164.387 USD	7,79 USD	4.400.603 USD	10,67 USD	138.874.267 USD	5,95 USD
31. Dezember 2021	396.356 USD	9,49 USD	8.046.885 USD	12,10 USD	184.244.304 USD	7,33 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.777.914 USD	6,12 USD	10.920.480 USD	13,23 USD	753.439 USD	6,98 USD
31. Dezember 2022	1.835.534 USD	5,99 USD	7.598.079 USD	12,02 USD	742.761 USD	6,77 USD
31. Dezember 2021	2.475.154 USD	7,37 USD	9.902.784 USD	13,80 USD	899.075 USD	8,20 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD U NIW	Thesaurierende Klasse USD U NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	7.443.249 USD	14,68 USD	44.696.204 USD	14,17 USD	299.231.482 ZAR	53,93 ZAR
31. Dezember 2022	11.371.297 USD	13,22 USD	64.829.210 USD	12,65 USD	372.548.933 ZAR	53,76 ZAR
31. Dezember 2021	15.400.385 USD	15,05 USD	79.110.967 USD	14,26 USD	696.637.863 ZAR	67,31 ZAR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil
31. Dezember 2023	444.980 ZAR	53,88 ZAR	77.989.696 ZAR	53,32 ZAR	5.270.093 ZAR	166,67 ZAR
31. Dezember 2022	7.199.304 ZAR	53,71 ZAR	71.672.740 ZAR	53,15 ZAR	9.921.353 ZAR	148,94 ZAR
31. Dezember 2021	20.557.931 ZAR	67,24 ZAR	155.721.676 ZAR	66,55 ZAR	19.063.973 ZAR	166,84 ZAR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.559.123.624 ZAR	60,27 ZAR	18.144.180 ZAR	155,44 ZAR
31. Dezember 2022	1.678.189.332 ZAR	59,48 ZAR	15.485.308 ZAR	137,52 ZAR
31. Dezember 2021	2.264.598.515 ZAR	73,73 ZAR	23.982.306 ZAR	152,51 ZAR

InnovAsia 5G

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I4 NIW	Thesaurierende Klasse CHF I4 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	522.675 CHF	8,10 CHF	20.478 EUR	8,07 EUR	738.351 EUR	8,30 EUR
31. Dezember 2022	469.743 CHF	6,39 CHF	282.274 EUR	6,32 EUR	810.342 EUR	6,42 EUR
31. Dezember 2021	1.038.996 CHF	10,86 CHF	135.730 EUR	10,82 EUR	1.024.161 EUR	10,88 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR X NIW	Thesaurierende Klasse EUR X NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	36.614 EUR	9,50 EUR	4.020.738 EUR	8,11 EUR	33.870 SGD	16,68 SGD
31. Dezember 2022	29.209 EUR	7,58 EUR	3.134.258 EUR	6,33 EUR	26.331 SGD	12,97 SGD
31. Dezember 2021	30.846 EUR	11,94 EUR	5.357.398 EUR	10,83 EUR	44.171 SGD	21,75 SGD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SGD I4 NIW	Thesaurierende Klasse SGD I4 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD X NIW	Thesaurierende Klasse SGD X NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.025.335 SGD	17,18 SGD	314.342 SGD	16,78 SGD	4.546.493 USD	8,57 USD
31. Dezember 2022	696.450 SGD	13,20 SGD	343.196 SGD	13,02 SGD	125.519 USD	6,55 USD
31. Dezember 2021	1.144.153 SGD	21,88 SGD	573.039 SGD	21,78 SGD	274.762 USD	10,90 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I4 NIW	Thesaurierende Klasse USD I4 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	6.636.583 USD	8,76 USD	3.983.343 USD	8,83 USD	8.129 USD	8,13 USD
31. Dezember 2022	3.159.260 USD	6,64 USD	3.888.909 USD	6,67 USD	6.265 USD	6,26 USD
31. Dezember 2021	5.210.923 USD	10,95 USD	8.314.820 USD	10,97 USD	10.508 USD	10,51 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.609.703 USD	8,63 USD
31. Dezember 2022	1.765.309 USD	6,58 USD
31. Dezember 2021	3.123.295 USD	10,92 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Japanischen Aktienengagement

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	31.902 EUR	11,98 EUR	344.829 GBP	10,32 GBP	11.862.066 GBP	10,78 GBP
31. Dezember 2022	60.111.478 EUR	9,46 EUR	321.237 GBP	8,13 GBP	–	–
31. Dezember 2021	–	–	279.974 GBP	9,34 GBP	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I NIW	Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse JPY I NIW	Ausschüttende Klasse JPY I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	11.065.396 GBP	8,39 GBP	154.103.501 JPY	1.742,53 JPY	23.557.609 JPY	1.729,24 JPY
31. Dezember 2022	17.700 GBP	7,89 GBP	503.411.392 JPY	1.450,08 JPY	735.824.128 JPY	1.450,06 JPY
31. Dezember 2021	21.052 GBP	9,39 GBP	553.780.013 JPY	1.689,60 JPY	7.193.678.670 JPY	1.689,60 JPY

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse JPY I5 NIW	Thesaurierende Klasse JPY I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY Z NIW	Thesaurierende Klasse JPY Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	8.526.499.141 JPY	11.320,64 JPY	3.284.885.177 JPY	1.117,91 JPY
31. Dezember 2022	6.320.326.223 JPY	9.380,86 JPY	4.464.613.674 JPY	922,43 JPY
31. Dezember 2021	5.549.922.666 JPY	10.883,95 JPY	142.656.638 JPY	1.065,69 JPY

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.264.954 EUR	9,53 EUR	–	–	20.546 GBP	10,25 GBP
31. Dezember 2022	1.066.163 EUR	9,23 EUR	–	–	162.743 GBP	9,71 GBP
31. Dezember 2021	5.243.651 EUR	9,47 EUR	26.625 EUR	9,68 EUR	163.106 GBP	9,73 GBP

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SEK I NIW	Thesaurierende Klasse SEK I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SEK I NIW	Ausschüttende Klasse SEK I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	16.510.843 SEK	96,92 SEK	37.342 SEK	100,20 SEK	11.032 USD	10,21 USD
31. Dezember 2022	263.295.231 SEK	93,64 SEK	72.218 SEK	96,89 SEK	10.440 USD	9,66 USD
31. Dezember 2021	224.458.577 SEK	95,49 SEK	21.475.977 SEK	98,77 SEK	10.496 USD	9,71 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD X* NIW	Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	83.264 USD	10,46 USD
31. Dezember 2022	–	–	6.993.860 USD	9,84 USD
31. Dezember 2021	12.682.478 USD	9,80 USD	4.659.851 USD	9,84 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income**

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP P* NIW	Ausschüttende Klasse GBP P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2022	–	–	19.140 GBP	8,21 GBP	6.738.767 USD	10,32 USD
31. Dezember 2021	632.450 EUR	10,95 EUR	23.306 GBP	10,00 GBP	7.690.451 USD	11,79 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW	Thesaurierende Klasse USD C1* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I* NIW	Ausschüttende Klasse USD I* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	–	–	–	–
31. Dezember 2022	2.328.953 USD	9,89 USD	685.261 USD	11,59 USD	107.660 USD	8,72 USD
31. Dezember 2021	3.338.236 USD	11,40 USD	1.426.794 USD	13,15 USD	230.204 USD	10,51 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	–	–
31. Dezember 2022	–	–	1.477.940 USD	10,04 USD
31. Dezember 2021	6.841.262 USD	10,08 USD	2.435.670 USD	11,56 USD

** Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	159.766 EUR	14,54 EUR	41.022 EUR	10,36 EUR	39.387.728 EUR	16,80 EUR
31. Dezember 2022	132.041 EUR	11,62 EUR	269.618 EUR	8,21 EUR	36.872.226 EUR	13,43 EUR
31. Dezember 2021	218.365 EUR	16,56 EUR	4.751.960 EUR	11,60 EUR	43.990.496 EUR	17,08 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	34.429.616 EUR	19,34 EUR	32.890.078 USD	16,82 USD	1.572.905 USD	17,99 USD
31. Dezember 2022	30.152.894 EUR	15,72 EUR	26.824.764 USD	13,10 USD	1.947.673 USD	14,16 USD
31. Dezember 2021	36.913.115 EUR	20,33 EUR	34.030.030 USD	17,91 USD	4.295.234 USD	19,54 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	8.977.632 USD	17,15 USD	6.463.904 USD	17,14 USD	7.433.399 USD	18,16 USD
31. Dezember 2022	4.906.268 USD	13,25 USD	5.581.715 USD	13,24 USD	7.055.187 USD	14,25 USD
31. Dezember 2021	16.707.928 USD	17,96 USD	9.527.770 USD	17,94 USD	11.564.452 USD	19,64 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil
31. Dezember 2023	25.442.335 USD	19,90 USD
31. Dezember 2022	29.578.839 USD	15,48 USD
31. Dezember 2021	46.685.234 USD	21,13 USD

Next Generation Space Economy[2]

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	10.045.792 EUR	11,72 EUR	4.431.301 EUR	11,36 EUR	3.668.583 USD	12,23 USD
31. Dezember 2022	4.206.616 EUR	9,51 EUR	1.061.485 EUR	9,39 EUR	2.882.343 USD	9,61 USD

Responsible Asian Debt – Hard Currency

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	259.271 USD	7,78 USD	1.198.440 USD	11,63 USD	147.067 USD	9,09 USD
31. Dezember 2022	274.934 USD	7,83 USD	1.309.918 USD	10,99 USD	168.834 USD	8,68 USD
31. Dezember 2021	339.937 USD	9,54 USD	2.190.283 USD	12,77 USD	414.971 USD	10,19 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	354.813 USD	12,21 USD	75.939 USD	9,21 USD	10.140 USD	10,14 USD
31. Dezember 2022	344.730 USD	11,47 USD	10.492.727 USD	8,96 USD	10.118 USD	10,12 USD
31. Dezember 2021	546.459 USD	13,26 USD	10.231.270 USD	10,70 USD	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I4* NIW	Thesaurierende Klasse USD I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	10.918 USD	10,92 USD	311.342 USD	9,32 USD	10.045 USD	10,05 USD
31. Dezember 2022	10.229 USD	10,23 USD	490.875 USD	8,86 USD	10.098 USD	10,10 USD
31. Dezember 2021	–	–	696.734 USD	10,36 USD	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD X NIW	Thesaurierende Klasse USD X NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	19.846 USD	9,05 USD	61.533.403 USD	10,72 USD
31. Dezember 2022	18.734 USD	8,54 USD	8.490.714 USD	10,01 USD
31. Dezember 2021	9.868 USD	9,87 USD	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF A NIW	Thesaurierende Klasse CHF A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.587.360 AUD	7,87 AUD	418.704 CAD	8,23 CAD	3.242.251 CHF	9,54 CHF
31. Dezember 2022	2.610.697 AUD	7,91 AUD	4.375.456 CAD	8,21 CAD	4.483.337 CHF	9,23 CHF
31. Dezember 2021	2.969.460 AUD	9,04 AUD	4.970.148 CAD	9,33 CAD	6.727.866 CHF	10,23 CHF

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse CHF A NIW	Ausschüttende Klasse CHF A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I NIW	Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CHF I NIW	Ausschüttende Klasse CHF I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	566.322 CHF	6,80 CHF	6.601.108 CHF	10,01 CHF	725.354 CHF	6,82 CHF
31. Dezember 2022	824.695 CHF	6,80 CHF	12.634.709 CHF	9,64 CHF	1.149.563 CHF	6,82 CHF
31. Dezember 2021	924.838 CHF	7,79 CHF	16.005.206 CHF	10,63 CHF	871.394 CHF	7,82 CHF

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW	Thesaurierende Klasse CHF I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CHF I2 NIW	Ausschüttende Klasse CHF I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I5 NIW	Thesaurierende Klasse CHF I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	10.145.427 CHF	10,23 CHF	60.679 CHF	7,49 CHF	1.561.093 CHF	10,44 CHF
31. Dezember 2022	19.647.200 CHF	9,84 CHF	12.395.410 CHF	7,49 CHF	1.515.754 CHF	10,02 CHF
31. Dezember 2021	3.566.030 CHF	10,84 CHF	14.461.747 CHF	8,58 CHF	4.483.203 CHF	11,03 CHF

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF P NIW	Thesaurierende Klasse CHF P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR A NIW	Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	29.312.877 CHF	9,68 CHF	104.971.926 EUR	10,06 EUR	15.305.883 EUR	7,18 EUR
31. Dezember 2022	27.905.942 CHF	9,32 CHF	117.630.713 EUR	9,55 EUR	16.574.105 EUR	7,04 EUR
31. Dezember 2021	41.732.801 CHF	10,27 CHF	166.225.000 EUR	10,55 EUR	21.287.062 EUR	8,05 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	685.080.531 EUR	10,56 EUR	154.181.903 EUR	7,18 EUR	181.322.110 EUR	10,65 EUR
31. Dezember 2022	712.003.973 EUR	9,98 EUR	163.594.524 EUR	7,05 EUR	214.675.538 EUR	10,06 EUR
31. Dezember 2021	1.145.591.264 EUR	10,97 EUR	167.167.694 EUR	8,05 EUR	116.405.182 EUR	11,05 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	52.300.087 EUR	7,77 EUR	6.260.518 EUR	11,07 EUR	2.460.584 EUR	9,76 EUR
31. Dezember 2022	59.488.811 EUR	7,63 EUR	6.256.930 EUR	10,43 EUR	2.699.887 EUR	9,33 EUR
31. Dezember 2021	14.135.350 EUR	8,72 EUR	6.699.994 EUR	11,44 EUR	3.298.298 EUR	10,36 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR M NIW	Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR P NIW	Thesaurierende Klasse EUR P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR U NIW	Thesaurierende Klasse EUR U NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.819.533 EUR	6,80 EUR	51.801.428 EUR	10,12 EUR	2.806.177 EUR	10,01 EUR
31. Dezember 2022	1.109.542 EUR	6,79 EUR	108.476.284 EUR	9,56 EUR	3.889.492 EUR	9,49 EUR
31. Dezember 2021	1.435.772 EUR	7,89 EUR	138.193.010 EUR	10,51 EUR	5.738.266 EUR	10,45 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR X NIW	Ausschüttende Klasse EUR X NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP A NIW	Thesaurierende Klasse GBP A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	50.236.839 EUR	8,97 EUR	1.023.476 GBP	10,69 GBP	2.374.631 GBP	11,06 GBP
31. Dezember 2022	49.291.318 EUR	8,80 EUR	1.784.594 GBP	10,00 GBP	4.696.255 GBP	10,30 GBP
31. Dezember 2021	56.344.451 EUR	10,06 EUR	1.987.812 GBP	10,87 GBP	4.507.349 GBP	11,14 GBP

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I NIW	Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.563.847 GBP	8,59 GBP	470.199 GBP	11,06 GBP	11.769.917 GBP	8,43 GBP
31. Dezember 2022	3.745.024 GBP	8,30 GBP	2.008.405 GBP	10,29 GBP	504.532.899 GBP	8,15 GBP
31. Dezember 2021	5.216.500 GBP	9,34 GBP	5.180.160 GBP	11,12 GBP	540.540.207 GBP	9,17 GBP

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I5 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P NIW	Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP P* NIW	Ausschüttende Klasse GBP P* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	143.767.963 GBP	7,92 GBP	1.773.074 GBP	10,39 GBP	–	–
31. Dezember 2022	130.424.601 GBP	7,66 GBP	1.656.455 GBP	9,67 GBP	–	–
31. Dezember 2021	112.065.803 GBP	8,62 GBP	626.791 GBP	10,45 GBP	276.207 GBP	9,69 GBP

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse JPY I NIW	Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse JPY I NIW	Ausschüttende Klasse JPY I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SEK A NIW	Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	78.935.623.550 JPY	1.045,62 JPY	3.877.798.381 JPY	707,66 JPY	10.553.645 SEK	98,35 SEK
31. Dezember 2022	90.490.215.829 JPY	1.024,16 JPY	3.875.746.192 JPY	719,95 JPY	15.573.259 SEK	93,27 SEK
31. Dezember 2021	102.280.856.951 JPY	1.126,55 JPY	9.105.341.406 JPY	824,34 JPY	25.446.053 SEK	102,60 SEK

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	60.789.842 SGD	16,04 SGD	28.236.679 USD	8,26 USD	359.043.792 USD	12,14 USD
31. Dezember 2022	40.192.701 SGD	16,13 SGD	23.230.997 USD	8,19 USD	412.842.165 USD	11,29 USD
31. Dezember 2021	39.123.251 SGD	18,32 SGD	28.852.590 USD	9,29 USD	623.897.960 USD	12,21 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD C1 NIW	Ausschüttende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	89.729.509 USD	8,44 USD	32.808.938 USD	10,35 USD	2.808.791 USD	8,92 USD
31. Dezember 2022	119.519.572 USD	8,11 USD	37.919.286 USD	9,72 USD	3.929.202 USD	8,57 USD
31. Dezember 2021	193.379.775 USD	9,07 USD	56.209.098 USD	10,62 USD	5.582.169 USD	9,58 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	678.406.064 USD	12,74 USD	81.258.937 USD	8,97 USD	36.449.926 USD	12,52 USD
31. Dezember 2022	741.407.065 USD	11,79 USD	81.356.489 USD	8,62 USD	159.773.031 USD	11,58 USD
31. Dezember 2021	1.145.025.152 USD	12,69 USD	213.794.766 USD	9,64 USD	125.167.562 USD	12,45 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I5 NIW	Ausschüttende Klasse USD I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	11.897.708 USD	8,96 USD	5.068.035 USD	12,98 USD	15.103.012 USD	8,58 USD
31. Dezember 2022	88.468.242 USD	8,61 USD	5.538.850 USD	11,98 USD	21.165.474 USD	8,25 USD
31. Dezember 2021	119.540.024 USD	9,63 USD	6.969.453 USD	12,86 USD	15.690.435 USD	9,23 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD P NIW	Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil
31. Dezember 2023	44.715.996 USD	10,62 USD	8.351.328 USD	8,02 USD	184.482.252 USD	12,34 USD
31. Dezember 2022	42.163.321 USD	9,94 USD	9.583.244 USD	7,84 USD	188.567.221 USD	11,42 USD
31. Dezember 2021	53.640.766 USD	10,82 USD	9.357.852 USD	8,92 USD	204.528.127 USD	12,29 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	24.595.101 USD	13,22 USD
31. Dezember 2022	14.055.349 USD	12,18 USD
31. Dezember 2021	26.986.290 USD	13,04 USD

Short Duration High Yield SDG Engagement

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF A NIW	Thesaurierende Klasse CHF A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I NIW	Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.140.803 AUD	7,10 AUD	441.932 CHF	11,27 CHF	239.547 CHF	12,28 CHF
31. Dezember 2022	1.192.743 AUD	7,08 AUD	790.227 CHF	10,75 CHF	227.034 CHF	11,64 CHF
31. Dezember 2021	485.095 AUD	7,96 AUD	921.175 CHF	11,58 CHF	243.222 CHF	12,47 CHF

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR A NIW	Ausschüttende Klasse EUR A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.036.218 CNY	83,39 CNY	12.464.115 EUR	12,07 EUR	1.917.691 EUR	6,89 EUR
31. Dezember 2022	2.048.761 CNY	84,25 CNY	11.761.196 EUR	11,29 EUR	2.515.236 EUR	6,76 EUR
31. Dezember 2021	2.153.866 CNY	94,05 CNY	15.735.732 EUR	12,13 EUR	2.971.545 EUR	7,61 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	50.324.368 EUR	12,94 EUR	42.272.021 EUR	12,01 EUR	976.342 EUR	10,64 EUR
31. Dezember 2022	39.889.511 EUR	12,03 EUR	5.785.967 EUR	11,15 EUR	922.543 EUR	10,01 EUR
31. Dezember 2021	56.858.937 EUR	12,85 EUR	1.046.828 EUR	11,90 EUR	1.703.444 EUR	10,82 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR M NIW	Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I NIW	Ausschüttende Klasse GBP I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	604.904 EUR	6,83 EUR	395.559 GBP	14,40 GBP	55.855.459 GBP	7,80 GBP
31. Dezember 2022	630.438 EUR	6,83 EUR	15.610.824 GBP	13,18 GBP	2.403.578 GBP	7,53 GBP
31. Dezember 2021	673.825 EUR	7,85 EUR	17.464.841 GBP	13,86 GBP	9.441.941 GBP	8,37 GBP

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.317.678 GBP	13,38 GBP	910.689 GBP	7,60 GBP	1.544.860 HKD	10,06 HKD
31. Dezember 2022	1.217.801 GBP	12,24 GBP	1.385.249 GBP	7,34 GBP	2.368.192 HKD	9,97 HKD
31. Dezember 2021	1.364.744 GBP	12,86 GBP	3.963.818 GBP	8,15 GBP	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse JPY I NIW	Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse JPY I* NIW	Ausschüttende Klasse JPY I* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	16.995.177.792 JPY	1.250,95 JPY	1.498.004.233 JPY	998,67 JPY	3.611.052 SGD	14,92 SGD
31. Dezember 2022	17.584.604.152 JPY	1.205,68 JPY	1.522.033.806 JPY	1.014,69 JPY	2.179.241 SGD	14,86 SGD
31. Dezember 2021	18.139.086.488 JPY	1.288,30 JPY	–	–	1.330.294 SGD	16,57 SGD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	4.053.791 USD	7,71 USD	34.032.810 USD	14,33 USD	8.347.581 USD	8,23 USD
31. Dezember 2022	3.099.464 USD	7,57 USD	35.220.346 USD	13,11 USD	9.519.536 USD	7,91 USD
31. Dezember 2021	4.487.058 USD	8,41 USD	39.948.103 USD	13,77 USD	9.670.590 USD	8,70 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.836.248 USD	11,10 USD	130.562.204 USD	15,39 USD	190.980.125 USD	8,42 USD
31. Dezember 2022	3.953.039 USD	10,26 USD	121.367.229 USD	14,00 USD	2.566.217 USD	8,09 USD
31. Dezember 2021	4.728.605 USD	10,89 USD	104.831.003 USD	14,61 USD	54.497.667 USD	8,87 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW	Ausschüttende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I4* NIW	Thesaurierende Klasse USD I4* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.524.302 USD	14,44 USD	288.566 USD	8,22 USD	2.996.390 USD	10,66 USD
31. Dezember 2022	94.032.462 USD	13,11 USD	1.874.619 USD	7,90 USD	–	–
31. Dezember 2021	114.549.884 USD	13,68 USD	2.373.346 USD	8,69 USD	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	27.842.101 USD	11,07 USD	3.127.020 USD	11,46 USD	1.580.196 USD	8,17 USD
31. Dezember 2022	25.249.794 USD	10,04 USD	8.383.843 USD	10,55 USD	3.564.599 USD	8,00 USD
31. Dezember 2021	–	–	3.113.815 USD	11,15 USD	1.043.541 USD	8,97 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	5.677.635 USD	13,98 USD
31. Dezember 2022	9.845.241 USD	12,64 USD
31. Dezember 2021	11.252.560 USD	13,12 USD

Strategic Income

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	63.940.605 AUD	8,07 AUD	136.796.522 AUD	8,80 AUD	95.409.993 CNY	100,06 CNY
31. Dezember 2022	3.816.128 AUD	8,10 AUD	74.440.920 AUD	8,74 AUD	–	–
31. Dezember 2021	5.634.916 AUD	9,56 AUD	24.618.870 AUD	10,22 AUD	–	–

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	37.619.121 EUR	7,50 EUR	389.376 EUR	10,64 EUR	8.449.161 EUR	11,37 EUR
31. Dezember 2022	6.586.578 EUR	7,56 EUR	54.250 EUR	10,05 EUR	7.002.752 EUR	10,68 EUR
31. Dezember 2021	10.163.081 EUR	9,04 EUR	–	–	6.916.215 EUR	12,18 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.081.589 EUR	10,37 EUR	24.369.502 GBP	8,01 GBP	6.640.582 GBP	10,23 GBP
31. Dezember 2022	1.332.181 EUR	9,85 EUR	1.790.460 GBP	7,95 GBP	–	–
31. Dezember 2021	2.513.964 EUR	11,36 EUR	3.137.215 GBP	9,36 GBP	–	–

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I NIW	Thesaurierende Klasse JPY I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	722.673.278 HKD	8,35 HKD	11.524.159.611 JPY	1.092,06 JPY	4.519.951.299 JPY	1.926,94 JPY
31. Dezember 2022	11.395.657 HKD	8,31 HKD	12.532.729.742 JPY	1.065,57 JPY	3.890.984.078 JPY	1.656,82 JPY
31. Dezember 2021	19.938.038 HKD	9,76 HKD	15.036.546.020 JPY	1.216,93 JPY	3.786.009.340 JPY	1.610,18 JPY

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse JPY I CG NIW	Ausschüttende Klasse JPY I CG NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse JPY I NIW	Ausschüttende Klasse JPY I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY Z* NIW	Thesaurierende Klasse JPY Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.049.838.759 JPY	897,38 JPY	4.233.937 JPY	798,89 JPY	5.618.707.917 JPY	942,88 JPY
31. Dezember 2022	5.903.832.844 JPY	875,62 JPY	7.335.571.257 JPY	803,30 JPY	10.051.163.176 JPY	915,43 JPY
31. Dezember 2021	6.698.942.854 JPY	1.001,03 JPY	8.627.434.436 JPY	944,76 JPY	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	57.886.443 SGD	15,90 SGD	13.802.740 SGD	21,73 SGD	13.508.509 SGD	17,77 SGD
31. Dezember 2022	22.557.538 SGD	15,90 SGD	4.409.893 SGD	20,36 SGD	11.455.558 SGD	17,69 SGD
31. Dezember 2021	32.262.797 SGD	18,64 SGD	7.722.945 SGD	22,86 SGD	7.693.639 SGD	20,62 SGD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	222.806.283 USD	8,23 USD	483.593.209 USD	12,31 USD	23.776.739 USD	9,88 USD
31. Dezember 2022	39.825.935 USD	8,11 USD	302.568.244 USD	11,37 USD	15.250.191 USD	9,39 USD
31. Dezember 2021	66.114.445 USD	9,47 USD	324.126.174 USD	12,72 USD	17.807.491 USD	10,75 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	38.055.662 USD	10,71 USD	371.079.167 USD	13,36 USD	66.192.394 USD	9,93 USD
31. Dezember 2022	43.957.466 USD	9,99 USD	369.131.042 USD	12,27 USD	25.395.713 USD	9,43 USD
31. Dezember 2021	74.844.054 USD	11,29 USD	410.581.638 USD	13,67 USD	26.561.963 USD	10,80 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	111.584.156 USD	12,23 USD	10.651.057 USD	8,54 USD	46.701.595 USD	13,55 USD
31. Dezember 2022	70.446.108 USD	11,36 USD	8.239.009 USD	8,30 USD	42.846.054 USD	12,39 USD
31. Dezember 2021	81.107.940 USD	12,79 USD	9.575.854 USD	9,69 USD	51.445.533 USD	13,72 USD

Sustainable Asia High Yield

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP X* NIW	Thesaurierende Klasse GBP X* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	363.946 EUR	8,52 EUR	37.849 GBP	9,47 GBP	19.024 USD	7,07 USD
31. Dezember 2022	3.659.153 EUR	8,51 EUR	208.349 GBP	9,31 GBP	7.630 USD	7,63 USD
31. Dezember 2021	–	–	–	–	9.897 USD	9,90 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	8.400 USD	8,40 USD	10.423 USD	8,51 USD	21.484.485 USD	8,93 USD
31. Dezember 2022	8.284 USD	8,28 USD	10.219 USD	8,34 USD	20.955.845 USD	8,70 USD
31. Dezember 2021	9.897 USD	9,90 USD	24.729.451 USD	9,90 USD	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD Z* NIW	Ausschüttende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	6.587.073 USD	9,13 USD
31. Dezember 2022	6.793.345 USD	9,42 USD

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I NIW	Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I4* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	14.179.749 CHF	11,37 CHF	–	–	76.508 EUR	10,41 EUR
31. Dezember 2022	11.340.526 CHF	10,96 CHF	4.061.234 CHF	8,89 CHF	630.955 EUR	9,94 EUR
31. Dezember 2021	27.116.186 CHF	12,78 CHF	9.745.025 CHF	10,33 CHF	2.490.523 EUR	11,64 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	321.714 EUR	12,07 EUR	234.610 EUR	10,33 EUR	544.903 EUR	9,88 EUR
31. Dezember 2022	525.213 EUR	11,42 EUR	236.709 EUR	9,75 EUR	533.388 EUR	9,51 EUR
31. Dezember 2021	636.746 EUR	13,27 EUR	364.406 EUR	11,29 EUR	690.833 EUR	11,23 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR M NIW	Ausschüttende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR X NIW	Thesaurierende Klasse EUR X NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	447.000 EUR	6,56 EUR	44.702.260 EUR	10,99 EUR	10.422 GBP	13,25 GBP
31. Dezember 2022	383.031 EUR	6,66 EUR	42.148.804 EUR	10,36 EUR	26.641 GBP	12,35 GBP
31. Dezember 2021	530.868 EUR	8,30 EUR	48.759.321 EUR	11,99 EUR	134.857 GBP	14,13 GBP

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SEK A NIW	Thesaurierende Klasse SEK A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.108.721 SEK	91,82 SEK	689.907 USD	7,40 USD	5.070.217 USD	13,10 USD
31. Dezember 2022	2.904.877 SEK	87,48 SEK	625.857 USD	7,32 USD	6.344.534 USD	12,24 USD
31. Dezember 2021	5.351.492 SEK	102,06 SEK	4.027.009 USD	8,81 USD	7.973.303 USD	14,03 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	667.644 USD	9,88 USD	18.637.882 USD	14,24 USD	2.390.542 USD	9,07 USD
31. Dezember 2022	648.535 USD	9,32 USD	20.881.275 USD	13,20 USD	2.641.379 USD	8,77 USD
31. Dezember 2021	1.150.929 USD	10,80 USD	23.231.127 USD	15,01 USD	3.211.502 USD	10,41 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	515.679 USD	12,89 USD	–	–	863.972 USD	9,95 USD
31. Dezember 2022	775.368 USD	11,93 USD	338.193 USD	12,32 USD	752.825 USD	9,38 USD
31. Dezember 2021	1.015.839 USD	13,54 USD	516.979 USD	13,95 USD	1.058.465 USD	10,83 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD M NIW	Ausschüttende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	692.358 USD	7,24 USD
31. Dezember 2022	657.453 USD	7,19 USD
31. Dezember 2021	834.074 USD	8,76 USD

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I3* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	9.353.104 EUR	11,95 EUR	252.654.242 EUR	10,83 EUR	–	–
31. Dezember 2022	23.246.658 EUR	10,79 EUR	–	–	2.500.773 EUR	10,01 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2] (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	77.767.491 EUR	9,27 EUR	9.662 USD	9,66 USD	70.543.444 USD	9,71 USD
31. Dezember 2022	64.417.647 EUR	8,36 EUR	8.540 USD	8,54 USD	62.156.033 USD	8,55 USD

Tactical Macro[1]

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I* NIW	Thesaurierende Klasse USD I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	10.217 USD	10,22 USD	336.955 USD	10,24 USD	26.721.857 USD	10,26 USD

Ultra Short Term Euro Bond

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF P* NIW	Thesaurierende Klasse CHF P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF U NIW	Thesaurierende Klasse CHF U NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	806.151 CHF	102,04 CHF	5.645.975 CHF	101,34 CHF	19.721.648 EUR	100,22 EUR
31. Dezember 2022	770.086 CHF	97,48 CHF	6.454.030 CHF	96,91 CHF	5.076.654 EUR	94,09 EUR
31. Dezember 2021	–	–	2.120.553 CHF	102,92 CHF	8.850.107 EUR	99,83 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I NIW	Ausschüttende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	611.815.516 EUR	105,88 EUR	5.218.533 EUR	99,85 EUR	84.236.821 EUR	104,65 EUR
31. Dezember 2022	504.982.352 EUR	99,21 EUR	1.514.355 EUR	95,44 EUR	49.163.695 EUR	98,02 EUR
31. Dezember 2021	706.370.660 EUR	105,08 EUR	560.627 EUR	102,73 EUR	57.744.254 EUR	103,78 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR U NIW	Thesaurierende Klasse EUR U NIW je Anteil
31. Dezember 2023	179.474.473 EUR	106,36 EUR	8.273.743 EUR	98,98 EUR	10.246.656 EUR	103,96 EUR
31. Dezember 2022	163.327.491 EUR	99,56 EUR	75.202 EUR	93,22 EUR	3.981.734 EUR	97,51 EUR
31. Dezember 2021	233.134.238 EUR	105,34 EUR	25.116 EUR	99,50 EUR	6.150.837 EUR	103,38 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	2.038.202 EUR	107,11 EUR	2.128.401 USD	104,93 USD	67.391.984 USD	117,20 USD
31. Dezember 2022	2.239.437 EUR	100,17 EUR	2.354.804 USD	96,33 USD	86.457.213 USD	107,40 USD
31. Dezember 2021	63.252.625 EUR	105,86 EUR	4.003.742 USD	99,95 USD	89.530.032 USD	111,22 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF I NIW	Thesaurierende Klasse CHF I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse CHF I5* NIW	Thesaurierende Klasse CHF I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.933.894 CHF	9,07 CHF	–	–	6.159.807 EUR	8,94 EUR
31. Dezember 2022	3.430.851 CHF	10,34 CHF	1.500.147 CHF	10,74 CHF	32.208.149 EUR	10,07 EUR
31. Dezember 2021	5.076.587 CHF	9,72 CHF	472.414 CHF	10,05 CHF	53.757.935 EUR	9,52 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	9.422.087 EUR	9,40 EUR	7.184.374 EUR	9,72 EUR	–	–
31. Dezember 2022	157.192.927 EUR	10,51 EUR	15.201.022 EUR	10,85 EUR	6.769.918 EUR	11,01 EUR
31. Dezember 2021	305.145.203 EUR	9,86 EUR	12.747.338 EUR	10,16 EUR	9.432.020 EUR	10,29 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR P* NIW	Thesaurierende Klasse EUR P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I NIW	Thesaurierende Klasse GBP I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	658.504 EUR	8,66 EUR	202.696 EUR	8,83 EUR	13.299.187 GBP	10,47 GBP
31. Dezember 2022	1.654.675 EUR	9,83 EUR	28.465.642 EUR	9,85 EUR	77.383.312 GBP	11,52 GBP
31. Dezember 2021	572.638 EUR	9,37 EUR	–	–	57.830.517 GBP	10,61 GBP

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I2* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	583.156.807 GBP	10,52 GBP	262.553 GBP	9,07 GBP	33.902.989 GBP	10,72 GBP
31. Dezember 2022	876.636.906 GBP	11,56 GBP	76.067 GBP	9,96 GBP	244.341.482 GBP	11,74 GBP
31. Dezember 2021	692.453.177 GBP	10,63 GBP	–	–	128.525.804 GBP	10,77 GBP

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP P NIW	Thesaurierende Klasse GBP P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW	Thesaurierende Klasse GBP Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I* NIW	Thesaurierende Klasse JPY I* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	349.194.682 GBP	10,15 GBP	459.179 GBP	11,01 GBP	3.729.880.338 JPY	887,86 JPY
31. Dezember 2022	733.833.769 GBP	11,16 GBP	501.313 GBP	12,02 GBP	4.336.598.065 JPY	1.029,89 JPY
31. Dezember 2021	463.552.981 GBP	10,27 GBP	449.271 GBP	10,98 GBP	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse SGD A* NIW	Thesaurierende Klasse SGD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	8.864 SGD	19,35 SGD	36.187.195 USD	9,98 USD	3.919.547 USD	9,46 USD
31. Dezember 2022	201.328 SGD	20,11 SGD	76.331.807 USD	11,03 USD	7.019.785 USD	10,57 USD
31. Dezember 2021	–	–	37.795.631 USD	10,26 USD	8.347.357 USD	9,92 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW	Thesaurierende Klasse USD I5 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	190.714.139 USD	10,91 USD	46.326.710 USD	10,97 USD	10.932.246 USD	11,18 USD
31. Dezember 2022	253.706.005 USD	11,97 USD	59.598.401 USD	12,01 USD	23.473.722 USD	12,22 USD
31. Dezember 2021	160.413.816 USD	11,05 USD	70.576.833 USD	11,07 USD	17.185.423 USD	11,24 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD P NIW	Thesaurierende Klasse USD P NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	5.177.039 USD	9,77 USD	6.768.803 USD	10,62 USD	10.835.712 USD	11,31 USD
31. Dezember 2022	14.132.913 USD	10,89 USD	54.279.664 USD	11,66 USD	27.792.127 USD	12,32 USD
31. Dezember 2021	8.892.322 USD	10,21 USD	6.628.186 USD	10,76 USD	10.360.938 USD	11,28 USD

Uncorrelated Trading[2]**

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW	Thesaurierende Klasse EUR X* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD X* NIW	Thesaurierende Klasse USD X* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	–	–
31. Dezember 2022	649.030.110 EUR	9,83 EUR	18.184.485 USD	10,00 USD

** Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse JPY I3* NIW	Thesaurierende Klasse JPY I3* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	4.044.133.157 JPY	1.058,06 JPY	4.099.498 USD	18,69 USD	4.648.286 USD	27,83 USD
31. Dezember 2022	2.722.761.830 JPY	816,04 JPY	3.127.165 USD	13,76 USD	3.063.327 USD	20,34 USD
31. Dezember 2021	–	–	1.156.841 USD	18,74 USD	1.524.356 USD	27,49 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	6.328.003 USD	27,62 USD	5.680.856 USD	10,43 USD
31. Dezember 2022	4.623.317 USD	20,18 USD	7.737 USD	7,74 USD
31. Dezember 2021	6.250.342 USD	27,28 USD	–	–

US Equity Index PutWrite

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW	Ausschüttende Klasse EUR I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	4.043.345 EUR	13,19 EUR	5.017.909 EUR	9,95 EUR	583.657 EUR	13,18 EUR
31. Dezember 2022	519.574 EUR	11,69 EUR	4.848.784 EUR	8,83 EUR	769.301 EUR	11,65 EUR
31. Dezember 2021	639.232 EUR	13,45 EUR	2.284.710 EUR	10,38 EUR	2.418.683 EUR	13,37 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse EUR I4* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	27.686 EUR	10,07 EUR	307.642 EUR	11,98 EUR	15.677.985 GBP	14,79 GBP
31. Dezember 2022	–	–	295.878 EUR	10,76 EUR	32.974.906 GBP	13,58 GBP
31. Dezember 2021	–	–	425.718 EUR	12,56 EUR	24.332.662 GBP	13,50 GBP

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I3 NIW	Thesaurierende Klasse GBP I3 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	112.770.545 GBP	12,63 GBP	243.278.811 GBP	10,76 GBP	8.228 GBP	10,48 GBP
31. Dezember 2022	72.609.172 GBP	11,58 GBP	199.939.675 GBP	9,40 GBP	–	–
31. Dezember 2021	25.831.312 GBP	11,49 GBP	34.793.614 GBP	10,90 GBP	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I4* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I4* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I4* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	56.296.882 GBP	15,33 GBP	443.810 GBP	10,24 GBP
31. Dezember 2022	–	–	131.866.462 GBP	14,05 GBP	–	–
31. Dezember 2021	11.732 GBP	13,86 GBP	124.042.500 GBP	13,93 GBP	9.485 GBP	12,05 GBP

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	3.959.945 GBP	10,53 GBP	191.141 SGD	20,38 SGD	13.352.314 USD	14,98 USD
31. Dezember 2022	4.612.426 GBP	10,06 GBP	182.949 SGD	18,85 SGD	12.416.490 USD	13,06 USD
31. Dezember 2021	2.986.073 GBP	10,40 GBP	226.127 SGD	22,21 SGD	13.407.217 USD	14,70 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I3* NIW	Thesaurierende Klasse USD I3* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	10.367 USD	11,64 USD	69.249.366 USD	15,82 USD	–	–
31. Dezember 2022	11.585.856 USD	10,55 USD	55.168.614 USD	13,71 USD	–	–
31. Dezember 2021	13.863.352 USD	12,29 USD	69.629.787 USD	15,34 USD	11.565 USD	13,62 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I3 NIW	Ausschüttende Klasse USD I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I4 NIW	Thesaurierende Klasse USD I4 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	24.031.846 USD	10,47 USD	5.805.985 USD	15,37 USD	1.228.399 USD	14,02 USD
31. Dezember 2022	18.562.430 USD	9,09 USD	5.127.891 USD	13,29 USD	1.208.956 USD	12,32 USD
31. Dezember 2021	10.941.666 USD	10,39 USD	27.897.131 USD	14,84 USD	1.500.582 USD	13,98 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	52.893.166 USD	16,10 USD
31. Dezember 2022	37.615.063 USD	13,87 USD
31. Dezember 2021	44.044.794 USD	15,43 USD

US Large Cap Value

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	584.267 EUR	10,25 EUR	234.125 EUR	9,96 EUR	25.517.697 EUR	8,75 EUR
31. Dezember 2022	151.717 EUR	10,87 EUR	421.987 EUR	10,68 EUR	13.504.321 EUR	9,20 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	146.699.614 EUR	8,86 EUR	11.657.942 EUR	9,26 EUR	104.079.203 EUR	9,84 EUR
31. Dezember 2022	37.390.049 EUR	9,42 EUR	14.242.602 EUR	9,91 EUR	117.300.158 EUR	10,42 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	23.832 GBP	9,43 GBP	462.887 GBP	8,88 GBP	299.756 GBP	9,42 GBP
31. Dezember 2022	24.659 GBP	9,76 GBP	8.138 GBP	9,66 GBP	24.659 GBP	9,76 GBP

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	5.459.927 GBP	8,86 GBP	713.712.896 GBP	9,96 GBP	1.510.453 GBP	9,44 GBP
31. Dezember 2022	8.138 GBP	9,66 GBP	767.350.829 GBP	10,92 GBP	1.047.402 GBP	10,28 GBP

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP P* NIW	Ausschüttende Klasse GBP P* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW	Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	27.450 GBP	10,25 GBP	96.933.670 GBP	9,63 GBP	289.665 GBP	9,43 GBP
31. Dezember 2022	28.455 GBP	10,63 GBP	79.855.605 GBP	10,48 GBP	57.641 GBP	10,29 GBP

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A* NIW	Thesaurierende Klasse USD A* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I4* NIW	Ausschüttende Klasse USD I4* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	64.226.695 USD	9,18 USD	348.767.232 USD	10,01 USD	42.162.635 USD	9,31 USD
31. Dezember 2022	64.127.333 USD	9,50 USD	370.024.843 USD	10,28 USD	55.448.399 USD	9,63 USD
31. Dezember 2021	–	–	2.078.974 USD	10,39 USD	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW	Thesaurierende Klasse USD I5* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M* NIW	Thesaurierende Klasse USD M* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Y* NIW	Thesaurierende Klasse USD Y* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	42.443 USD	9,43 USD	21.629.855 USD	8,95 USD	99.162.277 USD	9,89 USD
31. Dezember 2022	51.156 USD	9,65 USD	47.864.951 USD	9,35 USD	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW	Thesaurierende Klasse USD Z* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	200.943 USD	9,90 USD
31. Dezember 2022	13.571.781 USD	10,10 USD

US Long Short Equity

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	260.420 EUR	11,44 EUR	32.376.271 EUR	12,46 EUR	35.415.422 EUR	11,75 EUR
31. Dezember 2022	607.101 EUR	10,40 EUR	36.739.571 EUR	11,22 EUR	36.252.558 EUR	10,54 EUR
31. Dezember 2021	1.675.441 EUR	11,66 EUR	60.421.071 EUR	12,47 EUR	130.408.305 EUR	11,67 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	2.749.134 EUR	11,14 EUR	–	–
31. Dezember 2022	–	–	3.231.098 EUR	10,21 EUR	–	–
31. Dezember 2021	31.303 EUR	11,30 EUR	4.350.418 EUR	11,53 EUR	26.260 GBP	10,70 GBP

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW	Ausschüttende Klasse GBP I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A1 NIW	Thesaurierende Klasse SGD A1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A (PF) NIW	Thesaurierende Klasse USD A (PF) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.560.470 GBP	11,34 GBP	175.595 SGD	26,86 SGD	1.596.521 USD	13,16 USD
31. Dezember 2022	553.045 GBP	10,08 GBP	306.753 SGD	24,13 SGD	2.738.736 USD	11,72 USD
31. Dezember 2021	2.475.584 GBP	10,98 GBP	586.015 SGD	26,43 SGD	2.895.442 USD	12,74 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A1 NIW	Thesaurierende Klasse USD A1 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I (PF) NIW	Ausschüttende Klasse USD I (PF) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	15.728.474 USD	13,33 USD	13.821.003 USD	14,24 USD	35.630.199 USD	13,83 USD
31. Dezember 2022	15.008.727 USD	11,86 USD	13.820.694 USD	12,63 USD	32.577.472 USD	12,33 USD
31. Dezember 2021	19.263.231 USD	12,97 USD	17.243.832 USD	13,77 USD	37.308.429 USD	13,31 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	31.634.246 USD	15,29 USD	11.481.908 USD	12,51 USD	951.613 USD	12,24 USD
31. Dezember 2022	49.565.162 USD	13,49 USD	13.048.932 USD	10,99 USD	1.229.714 USD	10,98 USD
31. Dezember 2021	30.548.534 USD	14,61 USD	123.743.798 USD	11,85 USD	1.323.213 USD	12,11 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD U NIW	Thesaurierende Klasse USD U NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.239.097 USD	13,99 USD	3.442.847 USD	17,13 USD
31. Dezember 2022	6.626.973 USD	12,39 USD	3.984.842 USD	14,90 USD
31. Dezember 2021	7.318.111 USD	13,49 USD	6.687.613 USD	15,93 USD

US Multi Cap Opportunities

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW	Thesaurierende Klasse EUR I3 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.190.855 AUD	18,33 AUD	2.064.476 AUD	17,38 AUD	2.192.792 EUR	26,06 EUR
31. Dezember 2022	1.517.141 AUD	16,18 AUD	1.676.142 AUD	15,19 AUD	1.895.752 EUR	22,53 EUR
31. Dezember 2021	2.111.989 AUD	20,43 AUD	2.011.793 AUD	18,99 AUD	2.356.991 EUR	28,01 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR1 A NIW	Thesaurierende Klasse EUR1 A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR1 I NIW	Thesaurierende Klasse EUR1 I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	485.467 EUR	18,00 EUR	2.025.069 EUR	28,67 EUR	3.590.284 EUR	31,53 EUR
31. Dezember 2022	493.074 EUR	15,91 EUR	1.953.365 EUR	25,08 EUR	3.440.135 EUR	27,36 EUR
31. Dezember 2021	691.776 EUR	20,22 EUR	2.709.496 EUR	31,56 EUR	5.287.010 EUR	34,13 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD B NIW	Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil
31. Dezember 2023	19.454 GBP	18,26 GBP	30.545.781 SGD	48,71 SGD	11.529.828 USD	20,61 USD
31. Dezember 2022	17.444 GBP	16,38 GBP	24.554.266 SGD	42,26 SGD	14.429.013 USD	17,80 USD
31. Dezember 2021	1.294.933 GBP	17,50 GBP	28.145.940 SGD	51,87 SGD	18.960.200 USD	21,90 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD E NIW	Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.857.404 USD	15,79 USD	11.020 USD	20,62 USD	12.497.526 USD	19,40 USD
31. Dezember 2022	1.855.172 USD	13,62 USD	775.262 USD	17,80 USD	12.157.572 USD	16,75 USD
31. Dezember 2021	2.930.473 USD	16,74 USD	1.349.591 USD	21,89 USD	14.699.492 USD	20,60 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I3 NIW	Ausschüttende Klasse USD I3 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	11.201 USD	11,20 USD	20.516.313 USD	30,97 USD	5.968.476 USD	27,71 USD
31. Dezember 2022	–	–	23.096.196 USD	26,14 USD	5.049.971 USD	23,44 USD
31. Dezember 2021	–	–	42.984.155 USD	31,41 USD	7.778.053 USD	28,22 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD U NIW	Thesaurierende Klasse USD U NIW je Anteil
31. Dezember 2023	7.990.996 USD	21,97 USD	20.597.988 USD	22,81 USD	51.624.971 USD	31,54 USD
31. Dezember 2022	8.827.718 USD	18,95 USD	18.665.561 USD	19,51 USD	55.179.479 USD	26,82 USD
31. Dezember 2021	63.859.463 USD	23,28 USD	16.287.199 USD	23,75 USD	74.307.003 USD	32,48 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD1 A NIW	Thesaurierende Klasse USD1 A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD1 I NIW	Thesaurierende Klasse USD1 I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	315.494 USD	26,27 USD	61.309.908 USD	34,23 USD	157.972.113 USD	38,63 USD
31. Dezember 2022	285.453 USD	22,06 USD	68.130.989 USD	29,24 USD	188.629.207 USD	32,71 USD
31. Dezember 2021	309.426 USD	26,38 USD	92.720.656 USD	35,57 USD	386.342.131 USD	39,46 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD1 I NIW	Ausschüttende Klasse USD1 I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	6.535.567 USD	37,27 USD	33.968.071 ZAR	306,92 ZAR	52.951 ZAR	305,28 ZAR
31. Dezember 2022	5.497.999 USD	31,57 USD	44.251.345 ZAR	258,68 ZAR	714.961 ZAR	257,19 ZAR
31. Dezember 2021	9.701.682 USD	38,08 USD	45.494.408 ZAR	310,31 ZAR	2.184.221 ZAR	308,51 ZAR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil
31. Dezember 2023	40.553.464 ZAR	282,64 ZAR	62.068.144 ZAR	339,34 ZAR
31. Dezember 2022	58.876.819 ZAR	238,22 ZAR	62.283.522 ZAR	283,17 ZAR
31. Dezember 2021	68.342.255 ZAR	285,76 ZAR	55.775.120 ZAR	336,29 ZAR

US Real Estate Securities

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD B NIW	Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil
31. Dezember 2023	3.363.584 AUD	8,36 AUD	2.517.096 AUD	7,64 AUD	1.491.037 AUD	11,86 AUD
31. Dezember 2022	5.496.298 AUD	8,13 AUD	3.710.929 AUD	7,53 AUD	1.551.669 AUD	11,22 AUD
31. Dezember 2021	6.760.622 AUD	12,16 AUD	6.027.167 AUD	11,41 AUD	2.600.014 AUD	16,33 AUD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD C2* NIW	Thesaurierende Klasse AUD C2* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	–	–	1.664.244 AUD	7,63 AUD
31. Dezember 2022	13.633 AUD	7,54 AUD	–	–	1.845.753 AUD	7,52 AUD
31. Dezember 2021	105.874 AUD	11,42 AUD	80.242 AUD	17,34 AUD	2.585.873 AUD	11,40 AUD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil
31. Dezember 2023	684.626 AUD	12,83 AUD	4.085.229 AUD	8,96 AUD	4.675.218 AUD	15,33 AUD
31. Dezember 2022	1.473.276 AUD	12,14 AUD	4.048.009 AUD	8,74 AUD	5.292.429 AUD	14,37 AUD
31. Dezember 2021	2.325.484 AUD	17,67 AUD	4.853.764 AUD	13,11 AUD	7.209.536 AUD	20,70 AUD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse CHF A NIW	Thesaurierende Klasse CHF A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.432.392 CHF	13,99 CHF	942.080 EUR	8,54 EUR	9.589.385 EUR	19,01 EUR
31. Dezember 2022	1.863.576 CHF	13,32 CHF	1.065.458 EUR	7,98 EUR	9.711.898 EUR	17,63 EUR
31. Dezember 2021	2.817.702 CHF	19,35 CHF	2.596.896 EUR	11,56 EUR	55.428.758 EUR	25,33 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse SGD A NIW	Thesaurierende Klasse SGD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	553.935 EUR	11,42 EUR	41.922.187 HKD	9,20 HKD	841.397 SGD	30,21 SGD
31. Dezember 2022	525.424 EUR	10,78 EUR	63.131.693 HKD	8,82 HKD	798.510 SGD	27,99 SGD
31. Dezember 2021	438.137 EUR	15,75 EUR	99.874.888 HKD	12,92 HKD	1.651.444 SGD	39,53 SGD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	26.897.176 USD	10,69 USD	184.962.493 USD	24,05 USD	13.581.267 USD	17,15 USD
31. Dezember 2022	34.765.827 USD	10,15 USD	219.433.044 USD	21,92 USD	14.624.460 USD	15,81 USD
31. Dezember 2021	62.774.093 USD	14,78 USD	326.167.994 USD	30,68 USD	22.321.099 USD	22,25 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD B NIW	Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW	Thesaurierende Klasse USD C1 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	18.281.128 USD	8,79 USD	10.818.583 USD	14,60 USD	11.437.427 USD	12,22 USD
31. Dezember 2022	21.360.783 USD	8,45 USD	17.275.041 USD	13,48 USD	13.832.889 USD	11,25 USD
31. Dezember 2021	33.168.750 USD	12,47 USD	29.310.925 USD	19,11 USD	28.282.999 USD	15,90 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C2* NIW	Thesaurierende Klasse USD C2* NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	–	–	–	–	7.924.348 USD	8,79 USD
31. Dezember 2022	285.279 USD	8,56 USD	345.981 USD	13,47 USD	9.804.365 USD	8,45 USD
31. Dezember 2021	749.291 USD	12,63 USD	688.744 USD	19,10 USD	15.300.421 USD	12,47 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD E NIW	Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil
31. Dezember 2023	7.630.425 USD	13,85 USD	214.529 USD	9,22 USD	109.751.203 USD	27,36 USD
31. Dezember 2022	11.862.421 USD	12,79 USD	202.117 USD	8,69 USD	136.972.776 USD	24,75 USD
31. Dezember 2021	24.475.060 USD	18,13 USD	344.192 USD	12,56 USD	195.054.656 USD	34,38 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW	Thesaurierende Klasse USD I2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	8.362.345 USD	15,75 USD	17.723.091 USD	20,15 USD	35.815.499 USD	14,25 USD
31. Dezember 2022	8.086.151 USD	14,51 USD	16.291.811 USD	18,19 USD	47.619.174 USD	13,12 USD
31. Dezember 2021	10.560.006 USD	20,43 USD	2.122.857 USD	25,22 USD	77.016.676 USD	18,55 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	11.734.470 USD	10,21 USD	17.063.493 USD	16,18 USD	1.163.860 USD	16,00 USD
31. Dezember 2022	12.964.064 USD	9,72 USD	17.827.622 USD	14,79 USD	2.792.788 USD	14,36 USD
31. Dezember 2021	19.323.514 USD	14,20 USD	27.328.508 USD	20,76 USD	8.756.783 USD	19,79 USD

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW	Thesaurierende Klasse ZAR B NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)* NIW	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	80.144.798 ZAR	80,01 ZAR	22.512.585 ZAR	179,65 ZAR	–	–
31. Dezember 2022	95.145.043 ZAR	78,11 ZAR	32.016.598 ZAR	162,51 ZAR	2.020.359 ZAR	77,23 ZAR
31. Dezember 2021	138.032.992 ZAR	117,12 ZAR	47.169.493 ZAR	224,68 ZAR	6.006.511 ZAR	115,79 ZAR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW	Thesaurierende Klasse ZAR C2 NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil
31. Dezember 2023	315.043 ZAR	177,41 ZAR	41.472.352 ZAR	80,02 ZAR	27.239.513 ZAR	200,99 ZAR
31. Dezember 2022	955.698 ZAR	160,47 ZAR	50.137.837 ZAR	78,12 ZAR	28.025.473 ZAR	181,81 ZAR
31. Dezember 2021	1.359.201 ZAR	221,86 ZAR	84.148.761 ZAR	117,13 ZAR	31.306.257 ZAR	251,37 ZAR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil
31. Dezember 2023	97.954.018 ZAR	124,36 ZAR	40.917.501 ZAR	249,46 ZAR
31. Dezember 2022	103.488.803 ZAR	120,20 ZAR	47.847.359 ZAR	223,40 ZAR
31. Dezember 2021	142.721.631 ZAR	178,43 ZAR	48.481.475 ZAR	305,79 ZAR

US Small Cap

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD B NIW	Thesaurierende Klasse AUD B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW	Thesaurierende Klasse AUD C2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse AUD E NIW	Thesaurierende Klasse AUD E NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.742.449 AUD	11,99 AUD	11.823 AUD	11,70 AUD	2.052.624 AUD	16,78 AUD
31. Dezember 2022	1.174.595 AUD	10,86 AUD	17.906 AUD	10,59 AUD	1.486.516 AUD	15,20 AUD
31. Dezember 2021	1.981.465 AUD	14,09 AUD	16.019 AUD	13,74 AUD	2.328.434 AUD	19,71 AUD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse AUD T NIW	Thesaurierende Klasse AUD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A NIW	Thesaurierende Klasse EUR A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	1.621.168 AUD	15,66 AUD	1.411.931 EUR	17,04 EUR	368.951 EUR	13,95 EUR
31. Dezember 2022	1.570.235 AUD	14,04 AUD	2.265.778 EUR	15,29 EUR	368.888 EUR	12,63 EUR
31. Dezember 2021	1.820.027 AUD	18,03 AUD	3.484.945 EUR	19,76 EUR	258.498 EUR	14,80 EUR

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I NIW	Thesaurierende Klasse EUR I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil
31. Dezember 2023	7.003.214 EUR	20,33 EUR	4.743.299 EUR	18,23 EUR	8.827.680 EUR	17,02 EUR
31. Dezember 2022	3.429.996 EUR	18,08 EUR	3.457.660 EUR	16,36 EUR	22.369.014 EUR	15,26 EUR
31. Dezember 2021	15.210.300 EUR	23,17 EUR	5.166.629 EUR	19,01 EUR	22.971.126 EUR	17,70 EUR

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR M NIW	Thesaurierende Klasse EUR M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW	Thesaurierende Klasse EUR Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	49.451.043 EUR	11,02 EUR	359.461 EUR	17,10 EUR	373.669 EUR	19,39 EUR
31. Dezember 2022	38.159.092 EUR	9,86 EUR	213.152 EUR	15,49 EUR	323.177 EUR	17,10 EUR
31. Dezember 2021	–	–	196.729 EUR	20,22 EUR	405.073 EUR	21,73 EUR

Geschäftsjahr zum	Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW	Ausschüttende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD A NIW	Ausschüttende Klasse USD A NIW je Anteil
31. Dezember 2023	4.420.253.539 JPY	5,94 JPY	102.356.393 USD	27,90 USD	11.394.615 USD	18,01 USD
31. Dezember 2022	4.342.939.609 JPY	4,82 JPY	96.318.017 USD	24,40 USD	10.366.064 USD	15,75 USD
31. Dezember 2021	5.847.817.173 JPY	5,21 JPY	190.419.002 USD	30,47 USD	14.304.320 USD	19,67 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD B NIW	Thesaurierende Klasse USD B NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW	Thesaurierende Klasse USD C2 NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD E NIW	Thesaurierende Klasse USD E NIW je Anteil
31. Dezember 2023	9.816.052 USD	20,47 USD	3.134 USD	20,50 USD	4.842.626 USD	18,05 USD
31. Dezember 2022	7.251.318 USD	18,10 USD	61.322 USD	18,12 USD	2.587.858 USD	15,96 USD
31. Dezember 2021	10.526.062 USD	22,86 USD	181.210 USD	22,89 USD	7.216.838 USD	20,15 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Ausschüttende Klasse USD I NIW	Ausschüttende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW	Thesaurierende Klasse USD I3 NIW je Anteil
31. Dezember 2023	235.603.429 USD	31,17 USD	23.788.319 USD	22,68 USD	116.444.993 USD	15.647,89 USD
31. Dezember 2022	225.900.152 USD	27,02 USD	21.992.051 USD	19,66 USD	101.463.016 USD	13.534,58 USD
31. Dezember 2021	263.869.062 USD	33,46 USD	36.174.960 USD	24,35 USD	84.251.233 USD	16.717,30 USD

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD T NIW	Thesaurierende Klasse USD T NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD Z NIW	Thesaurierende Klasse USD Z NIW je Anteil
31. Dezember 2023	4.726.621 USD	20,63 USD	7.744.749 USD	22,73 USD	1.801.567 USD	21,30 USD
31. Dezember 2022	3.240.409 USD	18,23 USD	7.242.861 USD	19,89 USD	2.213.208 USD	18,32 USD
31. Dezember 2021	90.250.100 USD	22,98 USD	8.388.800 USD	24,87 USD	3.275.208 USD	22,49 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW	Thesaurierende Klasse ZAR E NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW	Thesaurierende Klasse ZAR T NIW je Anteil
31. Dezember 2023	8.580.171 ZAR	261,62 ZAR	16.439.253 ZAR	220,56 ZAR
31. Dezember 2022	18.435.416 ZAR	226,59 ZAR	18.202.064 ZAR	189,12 ZAR
31. Dezember 2021	21.140.644 ZAR	279,01 ZAR	30.686.645 ZAR	230,55 ZAR

US Small Cap Intrinsic Value

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) NIW	Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert) NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)* NIW	Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	76.995.502 GBP	10,82 GBP	18.429.244 GBP	10,05 GBP	641.072.643 JPY	1.012,53 JPY
31. Dezember 2022	42.248.255 GBP	10,04 GBP	13.137.811 GBP	9,31 GBP	–	–
31. Dezember 2021	22.099.755 GBP	11,24 GBP	9.171.753 GBP	10,40 GBP	–	–

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD A NIW	Thesaurierende Klasse USD A NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I NIW	Thesaurierende Klasse USD I NIW je Anteil	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW	Thesaurierende Klasse USD I2* NIW je Anteil
31. Dezember 2023	9.039.299 USD	21,63 USD	116.918.013 USD	19,18 USD	68.837.919 USD	9,66 USD
31. Dezember 2022	8.698.122 USD	19,11 USD	85.094.541 USD	16,80 USD	32.935.389 USD	8,44 USD
31. Dezember 2021	9.101.564 USD	24,28 USD	101.565.129 USD	21,17 USD	–	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

13. VERGLEICHSZAHLEN FÜR DEN NETTOINVENTARWERT (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

Geschäftsjahr zum	Thesaurierende Klasse USD M NIW	Thesaurierende Klasse USD M NIW je Anteil
31. Dezember 2023	415.451 USD	17,79 USD
31. Dezember 2022	500.654 USD	15,88 USD
31. Dezember 2021	579.481 USD	20,38 USD

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen oder vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt und/oder geschlossen.

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Bei den angegebenen Beträgen zum Nettoinventarwert und Nettoinventarwert je Anteil handelt es sich um Werte für den Handel mit Anteilinhabern.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

14. WECHSELKURSE

Zur Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres (31. Dezember 2023) wurden die folgenden Wechselkurse verwendet

1 USD = 3,67275 AED	1 USD = 22,34960 CZK	1 USD = 3,60090 ILS	1 USD = 1,57940 NZD	1 USD = 1,31910 SGD
1 USD = 975,38000 ARS	1 USD = 6,74835 DKK	1 USD = 83,21375 INR	1 USD = 3,70260 PEN	1 USD = 34,13250 THB
1 USD = 1,46552 AUD	1 USD = 58,06000 DOP	1 USD = 140,98000 JPY	1 USD = 55,37500 PHP	1 USD = 29,53400 TRY
1 USD = 4,85760 BRL	1 USD = 30,92500 EGP	1 USD = 157,00000 KES	1 USD = 3,93225 PLN	1 USD = 30,69050 TWD
1 USD = 1,31860 CAD	1 USD = 0,90526 EUR	1 USD = 1.287,90000 KRW	1 USD = 3,64100 QAR	1 USD = 3.780,00000 UGX
1 USD = 0,84165 CHF	1 USD = 0,78444 GBP	1 USD = 455,89000 KZT	1 USD = 4,50360 RON	1 USD = 39,04000 UYU
1 USD = 873,28500 CLP	1 USD = 11,91500 GHS	1 USD = 16,93450 MXN	1 USD = 106,13000 RSD	1 USD = 24.262,00000 VND
1 USD = 7,12060 CNH	1 USD = 7,80855 HKD	1 USD = 4,59500 MYR	1 USD = 89,40000 RUB	1 USD = 18,28750 ZAR
1 USD = 7,09220 CNY	1 USD = 346,00555 HUF	1 USD = 897,50000 NGN	1 USD = 3,75000 SAR	1 USD = 25,71030 ZMW
1 USD = 3.874,00000 COP	1 USD = 15.397,00000 IDR	1 USD = 10,15570 NOK	1 USD = 10,07785 SEK	

1 EUR = 1,61889 AUD	1 EUR = 24,68849 CZK	1 EUR = 8,62571 HKD	1 EUR = 4,34376 PLN	1 EUR = 1,45714 SGD
1 EUR = 1,45659 CAD	1 EUR = 7,45456 DKK	1 EUR = 155,73356 JPY	1 EUR = 11,13250 SEK	1 EUR = 1,10465 USD
1 EUR = 0,92973 CHF	1 EUR = 0,86653 GBP	1 EUR = 11,21849 NOK		

1 CNH = 1,00000 CNY	1 CNH = 0,11016 GBP	1 CNH = 0,18525 SGD
1 CNH = 0,12713 EUR	1 CNH = 1,09661 HKD	1 CNH = 0,14044 USD

1 ¥ = 0,00642 EUR	1 ¥ = 0,00556 GBP	1 ¥ = 0,00709 USD

Zur Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten am Ende des Geschäftsjahres (31. Dezember 2022) wurden die folgenden Wechselkurse verwendet

1 USD = 3,67265 AED	1 USD = 22,63200 CZK	1 USD = 3,52850 ILS	1 USD = 3,81350 PEN	1 USD = 34,63500 THB
1 USD = 324,90000 ARS	1 USD = 6,96785 DKK	1 USD = 82,73000 INR	1 USD = 55,72750 PHP	1 USD = 18,71950 TRY
1 USD = 1,47460 AUD	1 USD = 56,22000 DOP	1 USD = 131,94500 JPY	1 USD = 4,38625 PLN	1 USD = 30,73550 TWD
1 USD = 5,27975 BRL	1 USD = 24,75500 EGP	1 USD = 123,40000 KES	1 USD = 3,64175 QAR	1 USD = 3.720,00000 UGX
1 USD = 1,35495 CAD	1 USD = 0,93699 EUR	1 USD = 1.264,50000 KRW	1 USD = 4,63605 RON	1 USD = 39,76500 UYU
1 USD = 0,92520 CHF	1 USD = 0,83132 GBP	1 USD = 19,48725 MXN	1 USD = 109,92500 RSD	1 USD = 23.575,00000 VND
1 USD = 851,95000 CLP	1 USD = 10,20000 GHS	1 USD = 4,40500 MYR	1 USD = 73,00000 RUB	1 USD = 17,01500 ZAR
1 USD = 6,91885 CNH	1 USD = 7,80495 HKD	1 USD = 460,75000 NGN	1 USD = 3,75800 SAR	1 USD = 18,07500 ZMW
1 USD = 6,95170 CNY	1 USD = 375,21670 HUF	1 USD = 9,85100 NOK	1 USD = 10,41950 SEK	
1 USD = 4.848,88500 COP	1 USD = 15.567,50000 IDR	1 USD = 1,58115 NZD	1 USD = 1,34120 SGD	

1 EUR = 1,57377 AUD	1 EUR = 7,43644 DKK	1 EUR = 140,81830 JPY	1 EUR = 4,68123 PLN	1 EUR = 1,43140 SGD
1 EUR = 1,44607 CAD	1 EUR = 0,88723 GBP	1 EUR = 10,51348 NOK	1 EUR = 11,12021 SEK	1 EUR = 1,06725 USD
1 EUR = 0,98742 CHF	1 EUR = 8,32983 HKD			

1 CNH = 1,00000 CNY	1 CNH = 0,12015 GBP	1 CNH = 0,19385 SGD
1 CNH = 0,13543 EUR	1 CNH = 1,12807 HKD	1 CNH = 0,14453 USD

1 ¥ = 0,00758 USD

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

14. WECHSELKURSE (FORTSETZUNG)

AED	VAE-Dirham	HKD	Hongkong-Dollar	QAR	Katar-Rial
ARS	Argentinischer Peso	HUF	Ungarischer Forint	RON	Rumänischer neuer Leu
AUD	Australischer Dollar	IDR	Indonesische Rupiah	RSD	Serbischer Dinar
BRL	Brasilianischer Real	ILS	Israelischer Schekel	RUB	Russischer Rubel
CAD	Kanadischer Dollar	INR	Indische Rupie	SAR	Saudi-Riyal
CHF	Schweizer Franken	JPY	Japanischer Yen (¥)	SEK	Schwedische Krone
CLP	Chilenischer Peso	KES	Kenianischer Schilling	SGD	Singapur-Dollar
*CNH	Chinesischer Yuan Renminbi	KRW	Südkoreanischer Won	THB	Thailändischer Baht
*CNY	Chinesischer Yuan Renminbi	KZT	Kasachischer Tenge	TRY	Türkische Lira
COP	Kolumbianischer Peso	MXN	Mexikanischer Peso	TWD	Neuer taiwanesischer Dollar
CZK	Tschechische Krone	MYR	Malaysischer Ringgit	UGX	Uganda-Schilling
DKK	Dänische Krone	NGN	Nigerianischer Naira	USD	US-Dollar ($)
DOP	Dominikanischer Peso	NOK	Norwegische Krone	UYU	Uruguayischer Peso
EGP	Ägyptisches Pfund	NZD	Neuseeländischer Dollar	VND	Vietnamesischer Dong
EUR	Euro (€)	PEN	Peruanischer Sol	ZAR	Südafrikanischer Rand
GBP	Britisches Pfund (£)	PHP	Philippinischer Peso	ZMW	Sambischer Kwacha
GHS	Ghanaischer Cedi	PLN	Polnischer Zloty		

*Es gibt in China eine offizielle Währung, den chinesischen Yuan Renminbi. Der CNY wird „onshore", auf dem chinesischen Festland, gehandelt, der CNH „offshore", in erster Linie in Hongkong, zu jeweils unterschiedlichen Wechselkursen.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

15. BERICHTIGUNG DER WÄHRUNGSUMRECHNUNG

Der Konzernabschluss für den Fonds ist auf US-Dollar denominiert. Zum Zwecke der Berichterstattung der Gesamtergebnisse des Fonds wurden die Ergebnisse einiger Portfolios zu den nachstehend angegebenen Kursen in US-Dollar umgerechnet.

	Bilanz		Gewinn- und Verlustrechnung und die Aufstellung über die Entwicklung der auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	
	Schlusskurs		Durchschnittskurs	
Portfolio	31.Dezember 2023	31.Dezember 2022	31.Dezember 2023	31.Dezember 2022
China A-Share Equity	US$ 1 = CNY 7,09220	US$ 1 = CNY 6,95170	US$ 1 = CNY 7,08452	US$ 1 = CNY 6,72665
China Bond	US$ 1 = CNY 7,09220	US$ 1 = CNY 6,95170	US$ 1 = CNY 7,08452	US$ 1 = CNY 6,72665
Corporate Hybrid Bond	US$ 1 = EUR 0,90526	US$ 1 = EUR 0,93699	US$ 1 = EUR 0,92479	US$ 1 = EUR 0,94726
Euro Bond	US$ 1 = EUR 0,90526	US$ 1 = EUR 0,93699	US$ 1 = EUR 0,92479	US$ 1 = EUR 0,94726
Euro Bond Absolute Return	US$ 1 = EUR 0,90526	US$ 1 = EUR 0,93699	US$ 1 = EUR 0,92479	US$ 1 = EUR 0,94726
European High Yield Bond	US$ 1 = EUR 0,90526	US$ 1 = EUR 0,93699	US$ 1 = EUR 0,92479	US$ 1 = EUR 0,94726
European Sustainable Equity	US$ 1 = EUR 0,90526	US$ 1 = EUR 0,93699	US$ 1 = EUR 0,92479	US$ 1 = EUR 0,94726
Japan Equity Engagement	US$ 1 = JPY 140,9800	US$ 1 = JPY 131,9450	US$ 1 = JPY 140,6815	US$ 1 = JPY 130,6254
Macro Opportunities FX	US$ 1 = EUR 0,90526	US$ 1 = EUR 0,93699	US$ 1 = EUR 0,92479	US$ 1 = EUR 0,94726
Ultra Short Term Euro Bond	US$ 1 = EUR 0,90526	US$ 1 = EUR 0,93699	US$ 1 = EUR 0,92479	US$ 1 = EUR 0,94726

Aus der Umrechnung des Eröffnungsnettovermögens, der Gewinn- und Verlustrechnung und der Aufstellung über die Entwicklung des auf Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens ergab sich eine nominale Währungsanpassung von USD (111.001.114) (31. Dezember 2022: (304.151.197) US$). Die Umrechnungsmethode hat keinen Einfluss auf den Wert des Nettovermögens, der den einzelnen Portfolios zuzuschreiben ist.

16. VEREINBARUNGEN ÜBER PROVISIONSNACHLÄSSE (SOFT COMMISSIONS)

Der Manager und verbundene Personen haben in begrenzten Fällen Vereinbarungen über Provisionsnachlässe mit Brokern in Bezug auf Research-Produkte abgeschlossen unter der Voraussetzung, dass sie die beste Ausführung (Best Execution) zur Unterstützung von Anlagenentscheidungen erhalten.

Zu den erhaltenen Research-Leistungen gehören alle standardmäßigen Research-Produkte, insbesondere aktuelle und historische Daten in Bezug auf bestimmte Unternehmen, Branchen und die Finanzwirtschaft insgesamt sowie Informationen über Chancen, Risiken und Trends sowie Analysen in Bezug auf spezielle Situationen. Der Manager ist der Auffassung, dass diese Vereinbarungen den Portfolios zugute kommen, und hat sich davon überzeugt, dass er für die Portfolios die beste Ausführung erhält.

17. GETRENNTE HAFTUNG

Der Fonds hat mehrere Portfolios und weitere Portfolios können künftig aufgelegt werden. Mit der Zustimmung der Anteilinhaber des Fonds, die am 3. November 2006 durch einen Sonderbeschluss erteilt wurde, hat der Fonds die getrennte Haftung zwischen seinen Portfolios eingeführt. Ab diesem Datum trägt jedes Portfolio seine eigenen Verbindlichkeiten, und weder der Fonds noch die vom Fonds ernannten Dienstleistungsanbieter noch die Direktoren, Konkursverwalter, Prüfer oder Liquidatoren noch eine sonstige Person erhalten Zugriff auf die Vermögenswerte eines Portfolios zur Begleichung von Verbindlichkeiten eines anderen Portfolios.

18. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT

Der Fonds kann zu den Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die von der Zentralbank vorgegeben werden, in Bezug auf Wertpapiere und/oder Finanzinstrumente, einschließlich derivative Instrumente, Anlagetechniken und Instrumente anwenden, vorausgesetzt, dass diese für Zwecke des effizienten Portfoliomanagements (d. h. zur Absicherung, zur Reduzierung von Risiken oder Kosten oder zur Steigerung der Kapital- oder Ertragsrendite) oder für Anlagezwecke angewandt werden. Die angewandten Techniken und Instrumente dürfen nur in Einklang mit den Anlagezielen des jeweiligen Portfolios eingesetzt werden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

18. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT (Fortsetzung)

Nach Ermessen des Managers und des Sub-Investment-Managers kann jedes Portfolio zu den von den OGAW-Vorschriften der Zentralbank festgelegten Bedingungen und Grenzen für alle Arten von Vermögenswerten, in die das Portfolio anlegen kann, Wertpapierleihgeschäfte („Wertpapierleihverträge") abschließen, so wie im Abschnitt „Instrumente/Anlageklassen" im jeweiligen Zusatz für das Portfolio beschrieben. Solche Wertpapierleihgeschäfte können zum Zwecke des effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden.

Wertpapierleihverträge sind Transaktionen, über die ein Portfolio seine Wertpapiere an eine andere Partei, den Kreditnehmer, ausleiht, der vertraglich verpflichtet ist, zum Ende eines vereinbarten Zeitraums äquivalente Wertpapiere zurückzugeben. Solange die Wertpapiere ausgeliehen sind, zahlt der Kreditnehmer dem Portfolio (i) eine Kreditgebühr und (ii) Erträge aus den Wertpapieren.

Der Fonds erhielt für jedes Portfolio, das Wertpapierleihverträge abschloss, Sicherheiten in Höhe von mindestens 102 % des Werts der ausgeliehenen Wertpapiere. Portfolios können nur Wertpapierleihgeschäfte abschließen, im Rahmen derer (i) sie berechtigt sind, zu jeder Zeit die Rückgabe der verliehenen Wertpapiere zu beantragen oder die Wertpapierleihgeschäfte zu kündigen und (ii) die Transaktionen die Verwaltung der Vermögenswerte des Portfolios im Einklang mit seiner Anlagepolitik nicht gefährden. Sofern nicht anderweitig in dem entsprechenden Zusatz festgelegt, beträgt der maximale Anteil eines Nettoinventarwerts eines Portfolios, für den Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen werden können, 50 % und der erwartete Anteil eines Nettoinventarwerts, für den Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen werden, beträgt 0-10 %.

Der Fonds hat Brown Brothers Harriman & Co. (der „Lending Agent") damit beauftragt, die Wertpapierleihverträge auszuführen, darunter, vorbehaltlich der vorherigen Zustimmung durch den Fonds, die Auswahl der Gegenparteien und die Verwaltung der Sicherheit. Portfolios, die Wertpapierleihverträge eingingen, erhielten das gesamte Einkommen aus diesen Wertpapierleihverträgen, abzüglich direkter und indirekter Betriebskosten, das 90 % des insgesamt generierten Einkommens ausmachte. Die übrigen 10 % wurden an den Lending Agent als Gegenleistung für die direkten und indirekten Betriebskosten für die Erbringung seiner Dienstleistungen und die Bereitstellung seiner Garantie gezahlt. Die Gesellschaft stieg im Juli 2022 aus dem Wertpapierleihprogramm aus, die von den Portfolios in den entsprechenden Zeitraum aus der Wertpapierleihe verdienten Erträge werden separat in der Gewinn- und Verlustrechnung aufgeführt.

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hatte der Fonds keine Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen.

Im zum 31. Dezember 2023 endenden Geschäftsjahr haben der Corporate Hybrid Bond, der Emerging Market Debt Blend und der Short Duration Emerging Market Debt Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abgeschlossen. Die gesamten Zinserträge aus Pensionsgeschäften und umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 bei 1.613 US$ bzw. 38.355 US$. Die gesamten Zinsaufwendungen aus Pensionsgeschäften und umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 bei 2.677 US$ bzw. 175.821 US$. Direkte und indirekte Kosten im Zusammenhang mit effizienten Portfoliomanagementtechniken können nicht ohne Weiteres bestimmt werden.

Im zum 31. Dezember 2022 endenden Geschäftsjahr haben der Corporate Hybrid Bond, der Emerging Market Debt - Hard Currency, der Emerging Market Debt Blend, der High Yield Bond und der Short Duration Emerging Market Debt Pensionsgeschäfte abgeschlossen. Die gesamten Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 bei 140.059 US$. Die gesamten Zinsaufwendungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften lagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 bei 6.300 US$. Direkte und indirekte Kosten im Zusammenhang mit effizienten Portfoliomanagementtechniken können nicht ohne Weiteres bestimmt werden.

19. KREDITFAZILITÄT

Bei der Sitzung der Direktoren vom 20. Juni 2016 wurde mit The Bank of Tokyo Mitsubishi UFJ Ltd. vereinbart, dass sie zusammen mit einem Syndikat von anderen Banken (zusammen die „Kreditgeber") dem Fonds in Bezug auf die Portfolios ab dem Datum der Ausfertigung eines Kreditvertrags mit der Bank eine zugesagte Liquiditätsfazilität bis zu einem Höchstbetrag von 500.000.000 US$ (die „Fazilität") zur Verfügung stellt, und dass der Gegenwert der Fazilität nur für den vorübergehenden Liquiditätsbedarf oder in Notlagen in Anspruch genommen werden darf. Die Fazilität in Höhe von 850.000.000 US$ wurde am 28. September 2023 für den Zeitraum von 364 Tagen für sämtliche Portfolios verlängert. Die Kosten für die Bereitstellungsprovision wurden dementsprechend geändert.

Zum 31. Dezember 2023 gab es keine im Rahmen der Fazilität ausstehenden Kredite (31. Dezember 2022: ebenso). In den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 wurde die Kreditfazilität von keinem der Portfolios in Anspruch genommen

20. UNGEDECKTE KREDITZUSAGEN

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hatte der Fonds keine ungedeckten Kreditverbindlichkeiten.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

21. WICHTIGE EREIGNISSE WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHRES

Die wirtschaftlichen Unsicherheiten und Unsicherheiten am Finanzmarkt blieben angetrieben durch die anhaltend höhere Inflation und die Straffung der Geldpolitik weiter erhöht, da die Zentralbanken die Basiszinssätze erhöht und die Kreditbedingungen verschärft haben, was jüngste Ereignisse im Bankensektor zeigen. Diese Marktbedingungen tragen zu einer zusätzlichen Volatilität und Fluktuation bei den Marktvariablen bei, einschließlich unter anderem den Zinsen, Wechselkursen, Aktienkursen, Rohstoffpreisen, einer Erhöhung der Kreditspreads, implizierter Volatilitäten und Asset-Korrelationen. Das Management überwacht die Ereignisse und jegliche Engagements in Sektoren mit erhöhtem Risiko aktiv.

Ein neuer Multi-Strategy-Nachtrag zum Prospekt, der die Änderung der Berechnungsmethode der erfolgsabhängigen Gebühr für den Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund abdeckt, wurde von der Zentralbank am 3. Januar 2023 vermerkt.

Am 3. Januar 2023 wurden von der Zentralbank ein neuer Sustainable Asia High Yield-Nachtrag zum Prospekt vermerkt.

Am 7. Februar 2023 wurden von der Zentralbank ein neuer Fixed Income-Nachtrag zum Prospekt vermerkt.

Der Neuberger Berman Uncorrelated Trading Fund wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

Der Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Der Neuberger Berman Tactical Macro Fund wurde am 30. Juni 2023 aufgelegt.

Tom Finlay trat am 30. Juni 2023 als Direktor des Fonds in den Ruhestand.

Mit Wirkung vom 1. Juli 2023 löste Naomi Daly Tom Finlay als Vorsitzenden ab.

Der Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Der Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 wurde am 31. Juli 2023 aufgelegt.

Der Neuberger Berman Climate Innovation Fund wurde am 1. August 2023 aufgelegt.

Eine neue Version des Prospekts des Fonds und neue Zusätze zum Verkaufsprospekt, die sich auf Veränderungen aller Portfolios beziehen, wurden am 2. August 2023 von der Zentralbank entgegengenommen. Die Nachträge zum Verkaufsprospekt umfassen Änderungen an folgenden Fonds: Neuberger Berman China Equity Fund, Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency Fund, Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund, Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund, Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund, Neuberger Berman European High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Global SDG Engagement Fund, Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund, Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund, Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund, Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund, Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund, Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund, Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund und Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund.

Mit Wirkung zum 2. August 2023 wurde der Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund in Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund umbenannt.

Auf Empfehlung des Managers und in Übereinstimmung mit den Bedingungen des Prospekts und den Bestimmungen der Satzung hat der Verwaltungsrat als Schließungsdatum für den Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund den 7. September 2023 genehmigt.

Mit Wirkung zum 2. Oktober 2023 wurde der Neuberger Berman Asian Debt - Hard Currency Fund in Neuberger Berman Responsible Asian Debt – Hard Currency Fund umbenannt.

Mit Wirkung zum 5. Oktober 2023 stellte die Alcova Asset Management LLP ihre Tätigkeit als nicht verbundener Unterberater des Fonds ein.

Mit Wirkung zum 22. November 2023 wurde die G10 Capital Limited zum nicht verbundenen Unterberater des Fonds bestellt.

Mit Wirkung zum 23. November 2023 wurde die Cipher Capital LP zum nicht verbundenen Unterberater des Fonds bestellt.

Eine neue Version des Prospekts des Fonds und neue Zusätze zum Verkaufsprospekt, die sich auf Veränderungen aller Portfolios beziehen, wurden am 6. Dezember 2023 von der Zentralbank entgegengenommen. Die Nachträge zum aktualisierten Verkaufsprospekt umfassen die automatische Umwandlung von Anteilen der Klassen der Kategorien B, C2 und E in Anteile der entsprechenden Klasse A ohne zusätzliche Kosten für die Inhaber solcher Anteile nach Ablauf von vier Jahren (Klassen der Kategorie B), zwei Jahren (Klassen der Kategorie C2) und drei Jahren (Klassen der Kategorie E) ab dem Datum der Erstzeichnung der betreffenden Klasse B, C2 oder E.

Mit Wirkung zum 6. Dezember 2023 wurde der Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund in Neuberger Berman Euro Bond Fund umbenannt.

Mit Wirkung zum 15. Dezember 2023 stellte die Sandbar Asset Management LLP ihre Tätigkeit als nicht verbundener Unterberater des Fonds ein.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

21. WICHTIGE EREIGNISSE WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHRES (FORTSETZUNG)

Die Neuberger Berman Fund Management (China) Limited ersetzte die Neuberger Berman Investment Management (Shanghai) Limited als Anlageberater für den Neuberger Berman Emerging Market Debt - Local Currency Fund, den Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund und den Neuberger Berman China Bond Fund.

Außer den oben erwähnten sind während des Geschäftsjahres keine wesentlichen, den Fonds betreffenden Ereignisse eingetreten.

22. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES

Mit Wirkung zum 1. Februar 2024 wurde die Managementgebühr für den Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund für die Thesaurierende Klasse EUR I und die Thesaurierende Klasse USD I von 0,85 % auf 0,80 %, für die Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert), die Thesaurierende Klasse SGD A, die Thesaurierende Klasse USD A, die Thesaurierende Klasse USD C1, die Thesaurierende Klasse USD M von 1,70 % auf 1,60 % und für die Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert) von 0,81 % auf 0,76 % gesenkt.

Der Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund wurde am 8. Februar 2024 aufgelöst.

Im Zeitraum vom 1. Januar 2024 bis einschließlich 17. April 2024 gab es Zeichnungen und Rücknahmen in erheblichem Umfang, die in nachstehender Tabelle aufgeführt sind:

Portfolio	Währung	Zeichnungen	Rücknahmen
5G Connectivity	USD	80.992.584	170.735.714
China Bond	CNY	-	283.356.927
China Equity	USD	-	33.679.932
CLO Income	USD	62.938.053	-
Commodities	USD	14.552.424	19.998.728
Corporate Hybrid Bond	EUR	271.439.909	196.768.715
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	312.608.075	390.360.813
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	-	92.108.674
Emerging Markets Equity	USD	13.929.387	9.419.037
European High Yield Bond	EUR	70.845.614	-
Event Driven	USD	32.980.130	37.400.725
Global Diversified Income FMP – 2024	USD	-	26.905.692
Global Equity Megatrends	USD	38.727.635	12.658.089
Global Real Estate Securities	USD	2.791.772	1.532.456
Global Sustainable Equity	USD	-	9.044.273
Global Sustainable Value	USD	-	4.742.899
High Yield Bond	USD	-	126.843.853
Japan Equity Engagement	JPY	-	845.674.038
Macro Opportunities FX	EUR	-	2.932.820
Next Generation Mobility	USD	-	22.827.677
Next Generation Space Economy	USD	5.816.891	-
Short Duration Emerging Market Debt	USD	198.879.641	358.656.136
Short Duration High Yield SDG Engagement	USD	53.050.191	78.079.994
Strategic Income	USD	1.012.761.457	239.521.633
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	8.054.980	-
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	72.294.173	-
Tactical Macro	USD	5.280.247	-
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	193.377.608	133.963.573
Uncorrelated Strategies	USD	88.020.268	530.263.251

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

22. WESENTLICHE EREIGNISSE SEIT DEM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES (FORTSETZUNG)

Portfolio	Währung	Zeichnungen	Rücknahmen
US Equity	USD	33.832.093	15.230.335
US Equity Index PutWrite	USD	101.970.279	-
US Large Cap Value	USD	115.443.922	1.016.897.730
US Long Short Equity	USD	10.329.869	15.267.097
US Multi Cap Opportunities	USD	25.486.747	105.779.067
US Real Estate Securities	USD	-	56.901.186
US Small Cap	USD	114.251.542	163.467.499

Außer den oben erwähnten sind seit Jahresende keine wesentlichen, den Fonds betreffenden Ereignisse eingetreten.

23. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Die Direktoren haben den Jahresbericht und den geprüften Jahresabschluss am 17. April 2024 genehmigt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Investment Advisers LLC, einem bei der Securities Exchange Commission („SEC") in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA („US GAAP") entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

5G Connectivity

	Thesaurierende Klasse AUD A AUD	Thesaurierende Klasse AUD I2* AUD	Thesaurierende Klasse CHF A* CHF	Thesaurierende Klasse CHF I* CHF	Thesaurierende Klasse CHF I2* CHF	Thesaurierende Klasse CNY A CNY
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,98	10,00	10,00	10,00	10,00	57,01
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,11)	0,00	(0,05)	(0,02)	0,00	(0,80)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	2,90	1,32	0,67	0,67	1,37	20,30
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,79	1,32	0,62	0,65	1,37	19,50
Schlussnettoinventarwert	10,77	11,32	10,62	10,65	11,37	76,51
Gesamtertrag	34,96 %	13,20 %	6,20 %	6,50 %	13,70 %	34,20 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,79 %	0,80 %	1,76 %	0,95 %	0,79 %	1,84 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,18 %)	(0,15 %)	(1,20 %)	(0,39 %)	(0,15 %)	(1,23 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	14,75	–	–	–	–	101,38
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,14)	–	–	–	–	(1,01)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(6,63)	–	–	–	–	(43,36)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(6,77)	–	–	–	–	(44,37)
Schlussnettoinventarwert	7,98	–	–	–	–	57,01
Gesamtertrag	(45,90 %)	–	–	–	–	(43,77 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,85 %	–	–	–	–	1,86 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,39 %)	–	–	–	–	(1,41 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse CNY I2*	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I2*
	CNY	€	€	€	€	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	100,00	8,32	9,34	7,73	9,01	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,05)	(0,11)	(0,13)	(0,03)	(0,04)	0,00
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	13,47	3,01	3,27	2,80	3,17	1,32
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	13,42	2,90	3,14	2,77	3,13	1,32
Schlussnettoinventarwert	113,42	11,22	12,48	10,50	12,14	11,32
Gesamtertrag	13,42 %	34,86 %	33,62 %	35,83 %	34,74 %	13,20 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,82 %	1,80 %	1,80 %	0,97 %	0,96 %	0,81 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,16 %)	(1,20 %)	(1,19 %)	(0,36 %)	(0,37 %)	(0,15 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	15,39	15,55	14,16	14,87	–
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	–	(0,15)	(0,15)	(0,05)	(0,06)	–
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	–	(6,92)	(6,06)	(6,38)	(5,80)	–
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	(7,07)	(6,21)	(6,43)	(5,86)	–
Schlussnettoinventarwert	–	8,32	9,34	7,73	9,01	–
Gesamtertrag	–	(45,94 %)	(39,94 %)	(45,41 %)	(39,41 %)	–
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	–	1,78 %	1,78 %	0,95 %	0,95 %	–
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	(1,35 %)	(1,32 %)	(0,50 %)	(0,50 %)	–

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP A	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I2*	Thesaurierende Klasse HKD A
	€	€	£	£	£	HKD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	6,97	9,14	8,45	7,81	10,00	8,80
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,02)	(0,21)	(0,12)	(0,03)	0,00	(0,13)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	2,56	3,18	3,24	2,50	1,37	3,37
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,54	2,97	3,12	2,47	1,37	3,24
Schlussnettoinventarwert	9,51	12,11	11,57	10,28	11,37	12,04
Gesamtertrag	36,44 %	32,49 %	36,92 %	31,63 %	13,70 %	36,82 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,57 %	2,58 %	1,79 %	0,96 %	0,81 %	1,83 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,32 %)	(1,97 %)	(1,19 %)	(0,39 %)	(0,15 %)	(1,23 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,72	15,33	15,43	12,20	–	15,70
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,01)	(0,24)	(0,15)	(0,05)	–	(0,15)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(5,74)	(5,95)	(6,83)	(4,34)	–	(6,75)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,75)	(6,19)	(6,98)	(4,39)	–	(6,90)
Schlussnettoinventarwert	6,97	9,14	8,45	7,81	–	8,80
Gesamtertrag	(45,20 %)	(40,38 %)	(45,24 %)	(35,98 %)	–	(43,95 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,53 %	2,57 %	1,86 %	0,99 %	–	1,81 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,10 %)	(2,11 %)	(1,40 %)	(0,52 %)	–	(1,35 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse HKD I2* HKD	Thesaurierende Klasse SGD A SGD	Thesaurierende Klasse SGD I2* SGD	Thesaurierende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD E* US$	Thesaurierende Klasse USD I US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	17,27	20,00	9,12	10,00	9,79
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,00	(0,24)	(0,01)	(0,13)	(0,22)	(0,04)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	1,39	6,44	2,68	3,61	2,14	3,90
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,39	6,20	2,67	3,48	1,92	3,86
Schlussnettoinventarwert	11,39	23,47	22,67	12,60	11,92	13,65
Gesamtertrag	13,90 %	35,90 %	13,35 %	38,16 %	19,20 %	39,43 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,83 %	1,80 %	0,81 %	1,83 %	2,94 %	0,99 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,16 %)	(1,20 %)	(0,16 %)	(1,22 %)	(2,31 %)	(0,38 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	31,05	–	16,17	–	17,22
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	–	(0,28)	–	(0,15)	–	(0,06)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	–	(13,50)	–	(6,90)	–	(7,37)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	(13,78)	–	(7,05)	–	(7,43)
Schlussnettoinventarwert	–	17,27	–	9,12	–	9,79
Gesamtertrag	–	(44,38 %)	–	(43,60 %)	–	(43,15 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	–	1,76 %	–	1,81 %	–	0,96 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	(1,32 %)	–	(1,36 %)	–	(0,53 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I2 US$	Thesaurierende Klasse USD I3 US$	Thesaurierende Klasse USD I5 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,79	6,26	6,65	9,07	8,04	6,24
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,04)	(0,01)	(0,01)	0,01	(0,19)	0,04
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	3,90	2,49	2,66	3,62	3,17	2,50
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,86	2,48	2,65	3,63	2,98	2,54
Schlussnettoinventarwert	13,65	8,74	9,30	12,70	11,02	8,78
Gesamtertrag	39,43 %	39,62 %	39,85 %	40,02 %	37,06 %	40,71 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,99 %	0,81 %	0,73 %	0,56 %	2,64 %	0,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,37 %)	(0,21 %)	(0,11 %)	0,06 %	(2,02 %)	0,48 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	17,21	10,98	11,67	15,89	14,37	10,88
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,06)	(0,02)	(0,02)	(0,01)	(0,21)	0,03
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(7,36)	(4,70)	(5,00)	(6,81)	(6,12)	(4,67)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(7,42)	(4,72)	(5,02)	(6,82)	(6,33)	(4,64)
Schlussnettoinventarwert	9,79	6,26	6,65	9,07	8,04	6,24
Gesamtertrag	(43,11 %)	(42,99 %)	(43,02 %)	(42,92 %)	(44,05 %)	(42,65 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,96 %	0,79 %	0,71 %	0,54 %	2,61 %	0,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,51 %)	(0,33 %)	(0,24 %)	(0,12 %)	(2,15 %)	0,36 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR A* ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR E* ZAR
31. Dezember 2023		
Eröffnungsnettoinventarwert	100,00	100,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(1,08)	(2,20)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	26,71	28,45
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	25,63	26,25
Schlussnettoinventarwert	125,63	126,25
Gesamtertrag	25,63 %	26,25 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen++	1,78 %	2,85 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,12 %)	(2,22 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China A-Share Equity

	Thesaurierende Klasse CNY I	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)
	CNY	US$	US$
31. Dezember 2023			
Eröffnungsnettoinventarwert	91,62	9,28	9,27
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,60	0,06	0,06
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(11,88)	(1,44)	(1,43)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(11,28)	(1,38)	(1,37)
Ausschüttungen	–	–	(0,01)
Schlussnettoinventarwert	80,34	7,90	7,89
Gesamtertrag	(12,31 %)	(14,87 %)	(14,81 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen[++]	1,22 %	1,21 %	1,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,68 %	0,68 %	0,68 %
31. Dezember 2022			
Eröffnungsnettoinventarwert	118,49	13,05	13,05
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,09	0,03	0,01
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(26,96)	(3,80)	(3,79)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(26,87)	(3,77)	(3,78)
Schlussnettoinventarwert	91,62	9,28	9,27
Gesamtertrag	(22,68 %)	(28,89 %)	(28,97 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen[++]	1,22 %	1,18 %	1,18 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,09 %	0,27 %	0,09 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Bond

	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse CNY I**	Thesaurierende Klasse CNY Z	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)
	CNY	CNY	CNY	£	SGD	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	78,36	89,19	114,82	9,00	14,69	10,22
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	1,15	1,93	3,28	0,20	0,21	0,22
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,94	1,08	1,37	0,31	(0,47)	(0,17)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,09	3,01	4,65	0,51	(0,26)	0,05
Ausschüttungen	(3,90)	(1,59)	–	–	(0,72)	–
Schlussnettoinventarwert	76,55	90,61	119,47	9,51	13,71	10,27
Gesamtertrag	2,70 %	3,39 %	4,05 %	5,67 %	(1,88 %)	0,49 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,53 %	0,88 %	0,23 %	0,73 %	1,51 %	0,88 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,49 %	2,14 %	2,79 %	2,20 %	1,46 %	2,14 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	89,21	88,94	121,51	9,69	18,30	11,85
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	1,42	0,07	3,54	0,24	0,28	0,26
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(7,23)	0,18	(10,23)	(0,93)	(2,89)	(1,89)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,81)	0,25	(6,69)	(0,69)	(2,61)	(1,63)
Ausschüttungen	(5,04)	–	–	–	(1,00)	–
Schlussnettoinventarwert	78,36	89,19	114,82	9,00	14,69	10,22
Gesamtertrag	(6,70 %)	0,25 %***	(5,51 %)	(7,12 %)	(14,73 %)	(13,76 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,57 %	0,86 %	0,27 %	0,78 %	1,45 %	0,87 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,71 %	2,36 %	3,00 %	2,57 %	1,66 %	2,40 %

**Wiederaufnahme der Geschäfte am Dienstag, 12. Dezember 2022.

***Die Gesamtrendite für den Zeitraum von 1. Januar 2022 bis 15. November 2022 betrug (6,18) %.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US$	Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert) US$
31. Dezember 2023		
Eröffnungsnettoinventarwert	9,49	9,78
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,27	0,27
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,38	(0,17)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,65	0,10
Schlussnettoinventarwert	10,14	9,88
Gesamtertrag	6,85 %	1,02 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	0,23 %	0,23 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,77 %	2,77 %
31. Dezember 2022		
Eröffnungsnettoinventarwert	10,13	11,26
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,28	0,30
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,92)	(1,78)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,64)	(1,48)
Schlussnettoinventarwert	9,49	9,78
Gesamtertrag	(6,32 %)	(13,14 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	0,26 %	0,26 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,92 %	2,92 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Equity

	Thesaurierende Klasse CHF I CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR Z €	Ausschüttende Klasse GBP A £	Thesaurierende Klasse SGD A SGD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,23	21,49	23,33	18,02	10,70	30,18
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,09	0,01	0,16	0,30	0,01	0,01
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(3,21)	(5,32)	(5,80)	(4,50)	(2,52)	(7,29)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,12)	(5,31)	(5,64)	(4,20)	(2,51)	(7,28)
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,04)	–
Schlussnettoinventarwert	9,11	16,18	17,69	13,82	8,15	22,90
Gesamtertrag	(25,51 %)	(24,71 %)	(24,17 %)	(23,31 %)	(23,54 %)	(24,12 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,21 %	2,00 %	1,27 %	0,18 %	1,98 %	2,01 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,85 %	0,07 %	0,78 %	1,86 %	0,06 %	0,03 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	16,10	28,39	30,58	23,36	13,93	39,04
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,14	0,10	0,29	0,42	(0,20)	0,11
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(4,01)	(7,00)	(7,54)	(5,76)	(3,03)	(8,97)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,87)	(6,90)	(7,25)	(5,34)	(3,23)	(8,86)
Schlussnettoinventarwert	12,23	21,49	23,33	18,02	10,70	30,18
Gesamtertrag	(24,04 %)	(24,30 %)	(23,71 %)	(22,86 %)	(23,19 %)	(22,69 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,20 %	1,96 %	1,22 %	0,12 %	2,04 %	1,94 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,06 %	0,41 %	1,15 %	2,19 %	(1,39 %)	0,35 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A US$	Ausschüttende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I2 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD U US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	25,67	15,80	27,95	17,28	14,88	17,93
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,00	0,01	0,23	0,13	(0,13)	0,08
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(5,86)	(3,60)	(6,44)	(3,94)	(3,37)	(4,11)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,86)	(3,59)	(6,21)	(3,81)	(3,50)	(4,03)
Ausschüttungen	–	(0,06)	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	19,81	12,15	21,74	13,47	11,38	13,90
Gesamtertrag	(22,83 %)	(22,81 %)	(22,22 %)	(22,05 %)	(23,52 %)	(22,48 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,04 %	2,05 %	1,29 %	1,08 %	3,03 %	1,64 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,01 %	0,04 %	0,89 %	0,83 %	(0,96 %)	0,50 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	32,88	20,24	35,53	21,91	19,25	22,88
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,10	0,06	0,33	0,24	0,02	0,15
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(7,31)	(4,50)	(7,91)	(4,87)	(4,39)	(5,10)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(7,21)	(4,44)	(7,58)	(4,63)	(4,37)	(4,95)
Schlussnettoinventarwert	25,67	15,80	27,95	17,28	14,88	17,93
Gesamtertrag	(21,93 %)	(21,94 %)	(21,33 %)	(21,13 %)	(22,70 %)	(21,63 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,99 %	1,99 %	1,24 %	1,02 %	3,00 %	1,59 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,36 %	0,35 %	1,14 %	1,35 %	0,14 %	0,78 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023	
Eröffnungsnettoinventarwert	18,83
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,32
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(4,34)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,02)
Schlussnettoinventarwert	14,81
Gesamtertrag	(21,35 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,19 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,88 %
31. Dezember 2022	
Eröffnungsnettoinventarwert	23,68
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,44
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(5,29)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,85)
Schlussnettoinventarwert	18,83
Gesamtertrag	(20,48 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,23 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Climate Innovation[1]

	Thesaurierende Klasse USD A* US$	Thesaurierende Klasse USD I* US$	Thesaurierende Klasse USD I5* US$	Thesaurierende Klasse USD Z* US$
31. Dezember 2023				
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,04)	(0,01)	0,01	0,02
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,30)	(0,29)	(0,30)	(0,29)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,34)	(0,30)	(0,29)	(0,27)
Schlussnettoinventarwert	9,66	9,70	9,71	9,73
Gesamtertrag	(3,40 %)	(3,00 %)	(2,90 %)	(2,70 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	1,56 %	0,71 %	0,28 %	(0,14 %)
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,74 %)	0,11 %	0,54 %	0,96 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

CLO Income

	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I2 €	Thesaurierende Klasse GBP Z £	Thesaurierende Klasse SEK I SEK	Thesaurierende Klasse USD A US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,67	10,23	7,90	10,84	104,04	9,83
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	1,00	1,17	0,86	1,32	11,41	1,06
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,77	0,80	0,58	0,93	8,74	0,98
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,77	1,97	1,44	2,25	20,15	2,04
Ausschüttungen	–	–	(0,82)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,44	12,20	8,52	13,09	124,19	11,87
Gesamtertrag	18,30 %	19,26 %	19,33 %	20,76 %	19,37 %	20,75 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,62 %	0,90 %	0,74 %	0,16 %	0,86 %	1,65 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	9,66 %	10,36 %	10,65 %	11,11 %	10,11 %	9,86 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	11,21	9,24	11,60	113,40	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,43	0,83	0,62	0,89	8,01	0,45
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,76)	(1,81)	(1,41)	(1,65)	(17,37)	(0,62)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,33)	(0,98)	(0,79)	(0,76)	(9,36)	(0,17)
Ausschüttungen	–	–	(0,55)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,67	10,23	7,90	10,84	104,04	9,83
Gesamtertrag	(3,30 %)	(8,74 %)	(8,68 %)	(6,55 %)	(8,25 %)	(1,70 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,52 %	0,86 %	0,71 %	0,13 %	0,89 %	1,60 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	7,87 %	7,77 %	7,34 %	7,93 %	7,43 %	8,33 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I* US$	Ausschüttende Klasse USD I2 US$	Ausschüttende Klasse USD I5 US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023					
Eröffnungsnettoinventarwert	11,19	10,00	9,09	8,65	11,53
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	1,34	0,41	1,02	0,99	1,45
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,09	0,18	0,84	0,80	1,17
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,43	0,59	1,86	1,79	2,62
Ausschüttungen	–	(0,17)	(0,96)	(0,93)	–
Schlussnettoinventarwert	13,62	10,42	9,99	9,51	14,15
Gesamtertrag	21,72 %	5,97 %	21,73 %	22,04 %	22,72 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen[++]	0,93 %	0,97 %	0,76 %	0,53 %	0,16 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	10,59 %	10,86 %	10,80 %	11,07 %	11,40 %
31. Dezember 2022					
Eröffnungsnettoinventarwert	12,02	–	10,40	9,89	12,30
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,82	–	0,73	0,70	0,95
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,65)	–	(1,43)	(1,34)	(1,72)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,83)	–	(0,70)	(0,64)	(0,77)
Ausschüttungen	–	–	(0,61)	(0,60)	–
Schlussnettoinventarwert	11,19	–	9,09	8,65	11,53
Gesamtertrag	(6,91 %)	–	(6,82 %)	(6,54 %)	(6,26 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen[++]	0,87 %	–	0,71 %	0,49 %	0,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	7,19 %	–	7,71 %	7,79 %	8,17 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Commodities[2]

	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I5	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I5	Thesaurierende Klasse USD M
	£	£	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,43	9,42	9,71	11,20	9,78	8,91
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,22	0,20	0,10	0,22	0,21	0,05
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,45)	(0,88)	(0,81)	(0,95)	(0,82)	(0,75)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,23)	(0,68)	(0,71)	(0,73)	(0,61)	(0,70)
Schlussnettoinventarwert	9,20	8,74	9,00	10,47	9,17	8,21
Gesamtertrag	(11,79 %)	(7,22 %)	(7,31 %)	(6,52 %)	(6,24 %)	(7,86 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,85 %	0,53 %	1,61 %	0,86 %	0,54 %	2,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,27 %	2,26 %	1,10 %	2,04 %	2,22 %	0,54 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,01	0,07	(0,01)	(0,01)	0,06	(0,05)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,42	(0,65)	(0,28)	1,21	(0,28)	(1,04)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,43	(0,58)	(0,29)	1,20	(0,22)	(1,09)
Schlussnettoinventarwert	10,43	9,42	9,71	11,20	9,78	8,91
Gesamtertrag	4,30 %	(5,80 %)	(2,90 %)	12,00 %	(2,20 %)	(10,90 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,84 %	0,53 %	1,61 %	0,84 %	0,53 %	2,20 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,14 %	1,03 %	(0,14 %)	(0,08 %)	0,73 %	(0,84 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Commodities[2] (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023	
Eröffnungsnettoinventarwert	11,32
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,28
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,95)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,67)
Schlussnettoinventarwert	10,65
Gesamtertrag	(5,92 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,54 %
31. Dezember 2022	
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,12
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,20
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,32
Schlussnettoinventarwert	11,32
Gesamtertrag	11,64 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,27 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse CHF P	Ausschüttende Klasse CHF P	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I
	AUD	CHF	CHF	€	€	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,88	9,64	8,79	7,91	10,36	11,06
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,24	0,33	0,31	0,25	0,33	0,43
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,38	0,27	0,21	0,33	0,45	0,47
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,62	0,60	0,52	0,58	0,78	0,90
Ausschüttungen	(0,48)	–	(0,31)	(0,40)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,02	10,24	9,00	8,09	11,14	11,96
Gesamtertrag	8,14 %	6,22 %	6,09 %	7,57 %	7,53 %	8,14 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,29 %	0,64 %	0,64 %	1,30 %	1,30 %	0,70 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,10 %	3,36 %	3,59 %	3,11 %	3,12 %	3,74 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,58	11,27	10,61	9,67	12,14	12,88
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,23	0,33	0,30	0,23	0,29	0,38
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,51)	(1,96)	(1,82)	(1,63)	(2,07)	(2,20)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,28)	(1,63)	(1,52)	(1,40)	(1,78)	(1,82)
Ausschüttungen	(0,42)	–	(0,30)	(0,36)	–	–
Schlussnettoinventarwert	7,88	9,64	8,79	7,91	10,36	11,06
Gesamtertrag	(13,56 %)	(14,46 %)	(14,47 %)	(14,72 %)	(14,66 %)	(14,13 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,33 %	0,64 %	0,64 %	1,29 %	1,29 %	0,69 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,72 %	3,17 %	3,19 %	2,65 %	2,64 %	3,26 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Ausschüttende Klasse EUR I2 €	Thesaurierende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR I5 €	Thesaurierende Klasse EUR M €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,98	10,20	8,19	10,30	11,30	10,88
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,34	0,41	0,30	0,41	0,46	0,28
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,37	0,43	0,36	0,45	0,50	0,46
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,71	0,84	0,66	0,86	0,96	0,74
Ausschüttungen	(0,31)	–	(0,30)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,38	11,04	8,55	11,16	12,26	11,62
Gesamtertrag	8,17 %	8,24 %	8,24 %	8,35 %	8,50 %	6,80 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,70 %	0,58 %	0,58 %	0,52 %	0,40 %	1,90 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,76 %	3,87 %	3,67 %	3,84 %	3,94 %	2,50 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,80	11,86	9,85	11,97	13,12	12,82
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,31	0,36	0,29	0,37	0,42	0,24
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,82)	(2,02)	(1,66)	(2,04)	(2,24)	(2,18)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,51)	(1,66)	(1,37)	(1,67)	(1,82)	(1,94)
Ausschüttungen	(0,31)	–	(0,29)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,98	10,20	8,19	10,30	11,30	10,88
Gesamtertrag	(14,14 %)	(14,00 %)	(14,03 %)	(13,95 %)	(13,87 %)	(15,13 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,69 %	0,57 %	0,57 %	0,51 %	0,39 %	1,89 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,25 %	3,36 %	3,38 %	3,42 %	3,59 %	2,06 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR P €	Ausschüttende Klasse EUR P €	Thesaurierende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I2 £
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,61	9,84	9,02	10,54	10,38	9,09
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,19	0,36	0,36	0,39	0,39	0,33
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,32	0,45	0,35	0,65	0,65	0,55
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,51	0,81	0,71	1,04	1,04	0,88
Ausschüttungen	(0,32)	–	(0,32)	–	–	(0,33)
Schlussnettoinventarwert	7,80	10,65	9,41	11,58	11,42	9,64
Gesamtertrag	6,90 %	8,23 %	8,07 %	9,87 %	10,02 %	9,95 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,90 %	0,67 %	0,67 %	0,69 %	0,58 %	0,57 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,49 %	3,58 %	4,00 %	3,61 %	3,66 %	3,54 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,33	11,46	10,84	12,08	11,88	10,76
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,17	0,34	0,32	0,37	0,38	0,33
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,57)	(1,96)	(1,83)	(1,91)	(1,88)	(1,68)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,40)	(1,62)	(1,51)	(1,54)	(1,50)	(1,35)
Ausschüttungen	(0,32)	–	(0,31)	–	–	(0,32)
Schlussnettoinventarwert	7,61	9,84	9,02	10,54	10,38	9,09
Gesamtertrag	(15,17 %)	(14,14 %)	(14,05 %)	(12,75 %)	(12,63 %)	(12,63 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,89 %	0,66 %	0,66 %	0,71 %	0,59 %	0,59 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,04 %	3,18 %	3,23 %	3,38 %	3,48 %	3,48 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP P	Ausschüttende Klasse GBP P	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A
	£	£	SGD	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,48	8,78	16,07	8,26	11,18	8,44
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,35	0,33	0,50	0,26	0,37	0,27
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,59	0,52	0,79	0,51	0,72	0,53
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,94	0,85	1,29	0,77	1,09	0,80
Ausschüttungen	–	(0,31)	(0,96)	(0,54)	–	(0,25)
Schlussnettoinventarwert	10,42	9,32	16,40	8,49	12,27	8,99
Gesamtertrag	9,92 %	9,96 %	8,32 %	9,73 %	9,75 %	9,67 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,67 %	0,67 %	1,31 %	1,33 %	1,33 %	1,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,56 %	3,71 %	3,13 %	3,16 %	3,18 %	3,19 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,86	10,40	19,43	9,96	12,82	9,93
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,34	0,32	0,45	0,24	0,31	0,24
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,72)	(1,64)	(2,95)	(1,49)	(1,95)	(1,51)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,38)	(1,32)	(2,50)	(1,25)	(1,64)	(1,27)
Ausschüttungen	–	(0,30)	(0,86)	(0,45)	–	(0,22)
Schlussnettoinventarwert	9,48	8,78	16,07	8,26	11,18	8,44
Gesamtertrag	(12,71 %)	(12,77 %)	(13,05 %)	(12,77 %)	(12,79 %)	(12,83 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,68 %	0,68 %	1,27 %	1,30 %	1,30 %	1,30 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,42 %	3,42 %	2,61 %	2,68 %	2,68 %	2,70 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1 US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I2 US$	Ausschüttende Klasse USD I2 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,66	12,35	8,45	11,52	9,68	9,86
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,21	0,49	0,32	0,47	0,39	0,26
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,63	0,79	0,54	0,75	0,59	0,64
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,84	1,28	0,86	1,22	0,98	0,90
Ausschüttungen	–	–	(0,30)	–	(0,35)	–
Schlussnettoinventarwert	10,50	13,63	9,01	12,74	10,31	10,76
Gesamtertrag	8,70 %	10,36 %	10,44 %	10,59 %	10,45 %	9,13 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,35 %	0,71 %	0,72 %	0,59 %	0,59 %	1,94 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,08 %	3,78 %	3,73 %	3,89 %	3,91 %	2,54 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,19	14,08	9,94	13,12	11,39	11,38
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,17	0,41	0,29	0,38	0,35	0,21
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,70)	(2,14)	(1,50)	(1,98)	(1,73)	(1,73)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,53)	(1,73)	(1,21)	(1,60)	(1,38)	(1,52)
Ausschüttungen	–	–	(0,28)	–	(0,33)	–
Schlussnettoinventarwert	9,66	12,35	8,45	11,52	9,68	9,86
Gesamtertrag	(13,67 %)	(12,29 %)	(12,28 %)	(12,20 %)	(12,20 %)	(13,36 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,32 %	0,69 %	0,70 %	0,57 %	0,57 %	1,91 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,67 %	3,22 %	3,32 %	3,20 %	3,52 %	2,07 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD P US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023			
Eröffnungsnettoinventarwert	8,23	11,00	11,84
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,21	0,43	0,54
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,51	0,71	0,77
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,72	1,14	1,31
Ausschüttungen	(0,35)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,60	12,14	13,15
Gesamtertrag	9,01 %	10,36 %	11,06 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	1,94 %	0,69 %	0,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,55 %	3,74 %	4,41 %
31. Dezember 2022			
Eröffnungsnettoinventarwert	9,87	12,54	13,42
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,18	0,37	0,48
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,48)	(1,91)	(2,06)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,30)	(1,54)	(1,58)
Ausschüttungen	(0,34)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,23	11,00	11,84
Gesamtertrag	(13,35 %)	(12,28 %)	(11,77 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	1,91 %	0,66 %	0,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,08 %	3,23 %	3,97 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 2027[1]

	Thesaurierende Klasse EUR A* €	Ausschüttende Klasse EUR I* €	Thesaurierende Klasse USD A* US$	Ausschüttende Klasse USD A* US$	Thesaurierende Klasse USD I* US$	Ausschüttende Klasse USD I US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,14	0,11	0,15	0,15	0,16	0,14
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,17	0,27	0,23	0,23	0,24	0,34
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,31	0,38	0,38	0,38	0,40	0,48
Schlussnettoinventarwert	10,31	10,38	10,38	10,38	10,40	10,48
Gesamtertrag	3,10 %	3,80 %	3,80 %	3,80 %	4,00 %	4,80 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,77 %	0,39 %	0,78 %	0,79 %	0,44 %	0,41 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,40 %	3,89 %	3,54 %	3,51 %	3,81 %	3,95 %

	Thesaurierende Klasse USD X* US$	Ausschüttende Klasse USD X* US$
31. Dezember 2023		
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,16	0,15
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,23	0,24
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,39	0,39
Schlussnettoinventarwert	10,39	10,39
Gesamtertrag	3,90 %	3,90 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	0,53 %	0,54 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,81 %	3,62 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD I	Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse CHF I2	Thesaurierende Klasse CHF P	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)
	AUD	AUD	CAD	CHF	CHF	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	6,88	7,81	11,04	7,73	7,79	6,20
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,28	0,38	0,57	0,37	0,37	0,25
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,45	0,52	0,65	0,35	0,35	0,35
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,73	0,90	1,22	0,72	0,72	0,60
Ausschüttungen	(0,53)	(0,40)	–	–	–	(0,47)
Schlussnettoinventarwert	7,08	8,31	12,26	8,45	8,51	6,33
Gesamtertrag	11,27 %	12,11 %	11,05 %	9,31 %	9,24 %	10,37 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,47 %	0,79 %	0,58 %	0,62 %	0,72 %	1,47 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,11 %	4,83 %	4,97 %	4,72 %	4,61 %	4,09 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,17	10,32	10,00	9,80	9,89	8,36
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,35	0,45	0,10	0,42	0,42	0,30
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,22)	(2,50)	0,94	(2,49)	(2,52)	(2,08)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,87)	(2,05)	1,04	(2,07)	(2,10)	(1,78)
Ausschüttungen	(0,42)	(0,46)	–	–	–	(0,38)
Schlussnettoinventarwert	6,88	7,81	11,04	7,73	7,79	6,20
Gesamtertrag	(20,61 %)	(20,07 %)	10,40 %	(21,12 %)	(21,23 %)	(21,52 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,53 %	0,82 %	0,60 %	0,64 %	0,74 %	1,48 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,67 %	5,38 %	5,75 %	5,27 %	5,13 %	4,50 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I2	Ausschüttende Klasse EUR I2
	€	€	€	€	€	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,53	10,31	8,82	6,49	7,87	6,96
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,40	0,51	0,43	0,31	0,40	0,34
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,60	0,64	0,45	0,39	0,50	0,43
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,00	1,15	0,88	0,70	0,90	0,77
Ausschüttungen	–	–	–	(0,33)	–	(0,37)
Schlussnettoinventarwert	10,53	11,46	9,70	6,86	8,77	7,36
Gesamtertrag	10,49 %	11,15 %	9,98 %	11,36 %	11,44 %	11,56 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,48 %	0,79 %	0,79 %	0,79 %	0,65 %	0,65 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,09 %	4,81 %	4,78 %	4,79 %	4,91 %	4,92 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,16	13,06	10,22	8,68	9,96	9,32
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,45	0,58	0,45	0,36	0,44	0,40
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(3,08)	(3,33)	(1,85)	(2,17)	(2,53)	(2,34)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,63)	(2,75)	(1,40)	(1,81)	(2,09)	(1,94)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,38)	–	(0,42)
Schlussnettoinventarwert	9,53	10,31	8,82	6,49	7,87	6,96
Gesamtertrag	(21,63 %)	(21,06 %)	(13,70 %)	(21,04 %)	(20,98 %)	(21,02 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,48 %	0,79 %	0,79 %	0,79 %	0,65 %	0,65 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,51 %	5,13 %	5,32 %	5,18 %	5,31 %	5,34 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR I4	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR P
	€	€	€	€	€	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,83	9,97	10,00	8,95	6,16	7,98
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,46	0,52	0,53	0,30	0,20	0,40
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,55	0,64	0,51	0,56	0,36	0,50
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,01	1,16	1,04	0,86	0,56	0,90
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,36)	–
Schlussnettoinventarwert	9,84	11,13	11,04	9,81	6,36	8,88
Gesamtertrag	11,44 %	11,63 %	10,40 %	9,61 %	9,68 %	11,28 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,58 %	0,51 %	0,45 %	2,26 %	2,26 %	0,76 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,08 %	5,08 %	5,14 %	3,32 %	3,32 %	4,82 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,16	12,60	10,00	11,51	8,44	10,11
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,50	0,58	0,28	0,35	0,25	0,46
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,83)	(3,21)	(0,28)	(2,91)	(2,10)	(2,59)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,33)	(2,63)	0,00	(2,56)	(1,85)	(2,13)
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,43)	–
Schlussnettoinventarwert	8,83	9,97	10,00	8,95	6,16	7,98
Gesamtertrag	(20,88 %)	(20,87 %)	0,00 %	(22,24 %)	(22,23 %)	(21,07 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,58 %	0,51 %	0,43 %	2,26 %	2,26 %	0,75 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,43 %	5,46 %	5,64 %	3,71 %	3,69 %	5,12 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR Z €	Thesaurierende Klasse GBP I £	Ausschüttende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I2 £	Thesaurierende Klasse GBP P £
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,27	9,55	6,91	8,39	7,18	8,56
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,46	0,48	0,34	0,42	0,35	0,43
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,54	0,75	0,52	0,67	0,56	0,68
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,00	1,23	0,86	1,09	0,91	1,11
Ausschüttungen	–	–	(0,36)	–	(0,38)	–
Schlussnettoinventarwert	9,27	10,78	7,41	9,48	7,71	9,67
Gesamtertrag	12,09 %	12,88 %	12,97 %	12,99 %	13,28 %	12,97 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,11 %	0,79 %	0,78 %	0,65 %	0,65 %	0,75 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,42 %	4,83 %	4,84 %	4,85 %	4,85 %	4,87 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,41	11,92	9,11	10,45	9,47	10,68
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,51	0,54	0,42	0,49	0,43	0,48
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,65)	(2,91)	(2,21)	(2,55)	(2,28)	(2,60)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,14)	(2,37)	(1,79)	(2,06)	(1,85)	(2,12)
Ausschüttungen	–	–	(0,41)	–	(0,44)	–
Schlussnettoinventarwert	8,27	9,55	6,91	8,39	7,18	8,56
Gesamtertrag	(20,56 %)	(19,88 %)	(19,86 %)	(19,71 %)	(19,77 %)	(19,85 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,10 %	0,82 %	0,82 %	0,68 %	0,68 %	0,78 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,88 %	5,39 %	5,26 %	5,54 %	5,53 %	5,46 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse SEK A	Thesaurierende Klasse SEK I2	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)
	HKD	¥	SEK	SEK	SGD	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,38	816,31	91,78	77,53	13,92	6,89
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,31	40,64	3,85	3,93	0,57	0,29
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,52	19,88	5,84	4,99	0,92	0,56
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,83	60,52	9,69	8,92	1,49	0,85
Ausschüttungen	(0,57)	–	–	–	(1,07)	(0,53)
Schlussnettoinventarwert	7,64	876,83	101,47	86,45	14,34	7,21
Gesamtertrag	11,87 %	7,41 %	10,56 %	11,51 %	11,36 %	13,08 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,51 %	0,81 %	1,43 %	0,63 %	1,48 %	1,51 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,22 %	4,92 %	4,09 %	4,93 %	4,12 %	4,19 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,73	1.033,60	116,99	98,00	18,39	9,06
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,36	45,90	4,52	4,77	0,66	0,34
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(2,26)	(263,19)	(29,73)	(25,24)	(4,29)	(2,09)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,90)	(217,29)	(25,21)	(20,47)	(3,63)	(1,75)
Ausschüttungen	(0,45)	–	–	–	(0,84)	(0,42)
Schlussnettoinventarwert	7,38	816,31	91,78	77,53	13,92	6,89
Gesamtertrag	(19,74 %)	(21,02 %)	(21,55 %)	(20,89 %)	(19,90 %)	(19,53 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,50 %	0,80 %	1,55 %	0,68 %	1,46 %	1,50 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,55 %	5,28 %	4,76 %	5,44 %	4,45 %	4,56 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A US$	Ausschüttende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD C1 US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I2 US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,26	7,74	8,45	12,04	7,70	10,45
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,49	0,33	0,28	0,61	0,38	0,52
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,98	0,64	0,73	1,06	0,64	0,94
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,47	0,97	1,01	1,67	1,02	1,46
Ausschüttungen	–	(0,35)	–	–	(0,40)	–
Schlussnettoinventarwert	12,73	8,36	9,46	13,71	8,32	11,91
Gesamtertrag	13,06 %	13,01 %	11,95 %	13,87 %	13,87 %	13,97 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,51 %	1,51 %	2,51 %	0,81 %	0,81 %	0,67 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,17 %	4,23 %	3,19 %	4,88 %	4,90 %	4,74 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,99	10,06	10,60	14,86	10,02	12,87
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,53	0,37	0,32	0,66	0,43	0,60
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(3,26)	(2,32)	(2,47)	(3,48)	(2,31)	(3,02)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,73)	(1,95)	(2,15)	(2,82)	(1,88)	(2,42)
Ausschüttungen	–	(0,37)	–	–	(0,44)	–
Schlussnettoinventarwert	11,26	7,74	8,45	12,04	7,70	10,45
Gesamtertrag	(19,51 %)	(19,54 %)	(20,28 %)	(18,98 %)	(18,95 %)	(18,80 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,50 %	1,50 %	2,50 %	0,80 %	0,80 %	0,66 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,58 %	4,62 %	3,58 %	5,29 %	5,26 %	5,40 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I2 US$	Ausschüttende Klasse USD I3 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Ausschüttende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD P US$	Thesaurierende Klasse USD X US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,47	7,60	8,52	6,39	8,95	8,15
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,37	0,39	0,30	0,22	0,46	0,44
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,63	0,64	0,74	0,52	0,78	0,71
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,00	1,03	1,04	0,74	1,24	1,15
Ausschüttungen	(0,40)	(0,41)	–	(0,38)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,07	8,22	9,56	6,75	10,19	9,30
Gesamtertrag	14,00 %	14,22 %	12,21 %	12,26 %	13,85 %	14,11 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,67 %	0,60 %	2,31 %	2,31 %	0,77 %	0,52 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,93 %	5,10 %	3,38 %	3,39 %	4,92 %	5,16 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,71	9,89	10,67	8,52	11,03	10,03
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,43	0,44	0,34	0,26	0,49	0,46
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(2,23)	(2,28)	(2,49)	(1,96)	(2,57)	(2,34)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,80)	(1,84)	(2,15)	(1,70)	(2,08)	(1,88)
Ausschüttungen	(0,44)	(0,45)	–	(0,43)	–	–
Schlussnettoinventarwert	7,47	7,60	8,52	6,39	8,95	8,15
Gesamtertrag	(18,74 %)	(18,77 %)	(20,15 %)	(20,22 %)	(18,86 %)	(18,74 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,66 %	0,59 %	2,30 %	2,30 %	0,77 %	0,55 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,38 %	5,50 %	3,78 %	3,79 %	5,31 %	5,60 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023	
Eröffnungsnettoinventarwert	10,02
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,58
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,89
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,47
Schlussnettoinventarwert	11,49
Gesamtertrag	14,67 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,58 %
31. Dezember 2022	
Eröffnungsnettoinventarwert	12,27
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,64
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,89)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,25)
Schlussnettoinventarwert	10,02
Gesamtertrag	(18,34 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,77 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency

	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD B AUD	Thesaurierende Klasse AUD C2 AUD	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD E AUD	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) AUD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	3,54	7,62	7,61	3,54	7,61	3,81
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,10	0,23	0,23	0,10	0,23	0,15
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,22	0,49	0,50	0,23	0,49	0,23
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,32	0,72	0,73	0,33	0,72	0,38
Ausschüttungen	(0,35)	–	–	(0,35)	–	(0,37)
Schlussnettoinventarwert	3,51	8,34	8,34	3,52	8,33	3,82
Gesamtertrag	9,48 %	9,45 %	9,59 %	9,79 %	9,46 %	10,70 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,94 %	2,92 %	2,84 %	2,93 %	2,92 %	1,95 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,93 %	2,93 %	2,87 %	2,92 %	2,92 %	3,91 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	4,65	9,06	9,05	4,66	9,05	4,97
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,11	0,22	0,23	0,11	0,22	0,16
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,83)	(1,66)	(1,67)	(0,84)	(1,66)	(0,90)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,72)	(1,44)	(1,44)	(0,73)	(1,44)	(0,74)
Ausschüttungen	(0,39)	–	–	(0,39)	–	(0,42)
Schlussnettoinventarwert	3,54	7,62	7,61	3,54	7,61	3,81
Gesamtertrag	(15,78 %)	(15,89 %)	(15,91 %)	(15,97 %)	(15,91 %)	(15,20 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	3,04 %	3,03 %	3,03 %	3,04 %	3,03 %	2,00 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,74 %	2,77 %	2,57 %	2,70 %	2,77 %	3,84 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse AUD T	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)
	AUD	€	€	€	€	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,21	6,52	6,99	9,22	10,86	7,20
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,34	0,28	0,36	0,48	0,58	0,39
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,52	0,39	0,41	0,45	0,53	0,34
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,86	0,67	0,77	0,93	1,11	0,73
Ausschüttungen	–	–	–	–	–	(0,36)
Schlussnettoinventarwert	9,07	7,19	7,76	10,15	11,97	7,57
Gesamtertrag	10,48 %	10,28 %	11,02 %	10,09 %	10,22 %	10,41 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,94 %	1,65 %	0,93 %	0,92 %	0,78 %	0,63 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,91 %	4,16 %	4,92 %	4,97 %	5,11 %	5,26 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,66	7,75	8,25	9,93	11,69	8,12
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,32	0,28	0,35	0,45	0,55	0,38
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,77)	(1,51)	(1,61)	(1,16)	(1,38)	(0,93)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,45)	(1,23)	(1,26)	(0,71)	(0,83)	(0,55)
Ausschüttungen	–	–	–	–	–	(0,37)
Schlussnettoinventarwert	8,21	6,52	6,99	9,22	10,86	7,20
Gesamtertrag	(15,01 %)	(15,87 %)	(15,27 %)	(7,15 %)	(7,10 %)	(6,87 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	2,00 %	1,65 %	0,90 %	0,89 %	0,75 %	0,60 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,85 %	3,39 %	4,69 %	4,75 %	4,84 %	5,05 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse SEK A
	€	£	£	£	£	SEK
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,22	7,65	9,67	7,20	9,22	80,46
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,52	0,40	0,52	0,38	0,51	3,49
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,44	0,58	0,23	0,17	0,22	4,73
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,96	0,98	0,75	0,55	0,73	8,22
Ausschüttungen	–	–	–	(0,35)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,18	8,63	10,42	7,40	9,95	88,68
Gesamtertrag	10,41 %	12,81 %	7,76 %	7,94 %	7,92 %	10,22 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,54 %	0,94 %	0,63 %	0,63 %	0,54 %	1,61 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,35 %	4,95 %	5,22 %	5,23 %	5,34 %	4,14 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,89	8,89	9,83	7,69	9,36	95,54
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,48	0,39	0,50	0,38	0,49	3,50
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,15)	(1,63)	(0,66)	(0,51)	(0,63)	(18,58)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,67)	(1,24)	(0,16)	(0,13)	(0,14)	(15,08)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,36)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,22	7,65	9,67	7,20	9,22	80,46
Gesamtertrag	(6,77 %)	(13,95 %)	(1,63 %)	(1,63 %)	(1,50 %)	(15,78 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,51 %	0,93 %	0,63 %	0,64 %	0,54 %	1,71 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,13 %	4,93 %	5,21 %	5,17 %	5,29 %	4,17 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD B	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)
	SGD	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,66	4,73	7,78	3,97	7,99	3,97
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,45	0,21	0,36	0,12	0,25	0,12
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,71	0,38	0,65	0,32	0,67	0,32
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,16	0,59	1,01	0,44	0,92	0,44
Ausschüttungen	(0,79)	(0,35)	–	(0,39)	–	(0,39)
Schlussnettoinventarwert	11,03	4,97	8,79	4,02	8,91	4,02
Gesamtertrag	11,31 %	12,99 %	12,98 %	11,71 %	11,51 %	11,71 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,66 %	1,69 %	1,69 %	3,00 %	3,00 %	3,01 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,20 %	4,35 %	4,33 %	3,01 %	3,00 %	3,05 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,26	5,84	8,99	5,14	9,36	5,14
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,44	0,20	0,32	0,12	0,23	0,12
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(2,29)	(0,98)	(1,53)	(0,86)	(1,60)	(0,86)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,85)	(0,78)	(1,21)	(0,74)	(1,37)	(0,74)
Ausschüttungen	(0,75)	(0,33)	–	(0,43)	–	(0,43)
Schlussnettoinventarwert	10,66	4,73	7,78	3,97	7,99	3,97
Gesamtertrag	(14,02 %)	(13,38 %)	(13,46 %)	(14,56 %)	(14,64 %)	(14,56 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,61 %	1,67 %	1,66 %	2,97 %	2,98 %	2,97 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,95 %	4,04 %	4,07 %	2,70 %	2,66 %	2,70 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD E	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	3,97	7,99	7,52	8,36	6,94	8,12
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,12	0,26	0,39	0,45	0,36	0,45
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,32	0,67	0,62	0,71	0,58	0,69
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,44	0,93	1,01	1,16	0,94	1,14
Ausschüttungen	(0,39)	–	(0,56)	–	(0,33)	–
Schlussnettoinventarwert	4,02	8,92	7,97	9,52	7,55	9,26
Gesamtertrag	11,71 %	11,64 %	13,97 %	13,88 %	13,94 %	14,04 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	3,01 %	2,99 %	0,94 %	0,95 %	0,94 %	0,80 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,06 %	3,07 %	5,08 %	5,08 %	5,04 %	5,22 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	5,14	9,36	9,23	9,60	8,34	9,30
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,12	0,23	0,38	0,41	0,34	0,41
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,86)	(1,60)	(1,56)	(1,65)	(1,41)	(1,59)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,74)	(1,37)	(1,18)	(1,24)	(1,07)	(1,18)
Ausschüttungen	(0,43)	–	(0,53)	–	(0,33)	–
Schlussnettoinventarwert	3,97	7,99	7,52	8,36	6,94	8,12
Gesamtertrag	(14,56 %)	(14,64 %)	(12,87 %)	(12,92 %)	(12,85 %)	(12,69 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,97 %	2,96 %	0,91 %	0,91 %	0,93 %	0,76 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,73 %	2,75 %	4,80 %	4,82 %	4,72 %	4,96 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I5	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD T	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Y	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)
	US$	US$	US$	US$	US$	ZAR
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,08	4,35	8,61	8,27	8,03	36,58
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(2,11)	0,18	0,37	0,49	0,47	1,10
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	3,23	0,35	0,73	0,70	0,68	3,71
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,12	0,53	1,10	1,19	1,15	4,81
Ausschüttungen	–	(0,43)	–	–	–	(4,87)
Schlussnettoinventarwert	10,20	4,45	9,71	9,46	9,18	36,52
Gesamtertrag	12,33 %	12,86 %	12,78 %	14,39 %	14,32 %	14,22 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,56 %	2,00 %	2,00 %	0,49 %	0,56 %	3,00 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(22,17 %)	4,03 %	4,02 %	5,53 %	5,47 %	3,03 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,74	5,58	9,99	9,45	9,18	47,97
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(1.994,20)	0,17	0,33	0,44	0,42	1,16
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	1.992,54	(0,93)	(1,71)	(1,62)	(1,57)	(6,89)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,66)	(0,76)	(1,38)	(1,18)	(1,15)	(5,73)
Ausschüttungen	–	(0,47)	–	–	–	(5,66)
Schlussnettoinventarwert	9,08	4,35	8,61	8,27	8,03	36,58
Gesamtertrag	(15,46 %)	(13,76 %)	(13,81 %)	(12,49 %)	(12,53 %)	(12,08 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	–	1,96 %	1,95 %	0,48 %	0,52 %	3,08 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(21401,14 %)	3,78 %	3,79 %	5,26 %	5,23 %	2,80 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR B	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR C2**	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR E	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)
	ZAR	ZAR	ZAR	ZAR	ZAR	ZAR
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	107,97	36,57	107,65	36,58	107,98	39,47
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	3,61	1,08	3,31	1,09	3,55	1,57
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	11,70	3,75	10,41	3,72	11,70	4,04
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	15,31	4,83	13,72	4,81	15,25	5,61
Ausschüttungen	–	(4,87)	–	(4,87)	–	(5,28)
Schlussnettoinventarwert	123,28	36,53	121,37	36,52	123,23	39,80
Gesamtertrag	14,18 %	14,29 %	12,75 %***	14,22 %	14,12 %	15,36 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	2,95 %	3,05 %	2,95 %	2,99 %	2,86 %	1,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,13 %	2,92 %	2,97 %	3,01 %	3,06 %	4,00 %

**Wiederaufnahme der Geschäfte am Dienstag, 6. Januar 2023.

*** Die Gesamtrendite für den Zeitraum von 1. Januar 2023 bis 3. Januar 2023 betrug 0,30 %.

31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	122,85	47,95	122,83	47,96	122,85	51,24
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	3,18	1,17	3,37	1,17	3,20	1,66
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(18,06)	(6,89)	(18,23)	(6,89)	(18,07)	(7,36)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(14,88)	(5,72)	(14,86)	(5,72)	(14,87)	(5,70)
Ausschüttungen	–	(5,66)	–	(5,66)	–	(6,07)
Schlussnettoinventarwert	107,97	36,57	107,97	36,58	107,98	39,47
Gesamtertrag	(12,11 %)	(12,07 %)	(12,10 %)	(12,07 %)	(12,10 %)	(11,19 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	3,08 %	3,09 %	3,09 %	3,09 %	3,09 %	2,03 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,81 %	2,76 %	2,66 %	2,77 %	2,74 %	3,91 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR
31. Dezember 2023	
Eröffnungsnettoinventarwert	116,49
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	4,98
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	12,88
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	17,86
Schlussnettoinventarwert	134,35
Gesamtertrag	15,33 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	1,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,99 %
31. Dezember 2022	
Eröffnungsnettoinventarwert	131,23
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	4,58
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(19,32)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(14,74)
Schlussnettoinventarwert	116,49
Gesamtertrag	(11,23 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	2,03 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,93 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

	Ausschüttende Klasse AUD I3 AUD	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Ausschüttende Klasse EUR I2 €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,49	9,66	9,92	6,93	10,19	6,74
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,37	0,39	0,47	0,32	0,50	0,32
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,46	0,41	0,42	0,28	0,43	0,28
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,83	0,80	0,89	0,60	0,93	0,60
Ausschüttungen	(0,36)	–	–	(0,31)	–	(0,31)
Schlussnettoinventarwert	7,96	10,46	10,81	7,22	11,12	7,03
Gesamtertrag	11,37 %	8,28 %	8,97 %	8,97 %	9,13 %	9,24 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,58 %	1,48 %	0,79 %	0,79 %	0,66 %	0,66 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,82 %	3,95 %	4,63 %	4,64 %	4,77 %	4,78 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,87	11,09	11,31	8,29	11,60	8,07
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,41	0,43	0,51	0,36	0,53	0,36
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,39)	(1,86)	(1,90)	(1,36)	(1,94)	(1,33)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,98)	(1,43)	(1,39)	(1,00)	(1,41)	(0,97)
Ausschüttungen	(0,40)	–	–	(0,36)	–	(0,36)
Schlussnettoinventarwert	7,49	9,66	9,92	6,93	10,19	6,74
Gesamtertrag	(11,15 %)	(12,89 %)	(12,29 %)	(12,26 %)	(12,16 %)	(12,21 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,68 %	1,55 %	0,87 %	0,87 %	0,73 %	0,73 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,38 %	4,28 %	4,91 %	4,92 %	4,98 %	4,99 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert) JPY I	Thesaurierende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z
	€	€	€	€	€	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,48	9,81	10,76	9,32	6,05	10,65
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,36	0,50	0,55	0,30	0,18	0,58
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,32	0,36	0,46	0,40	0,23	0,47
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,68	0,86	1,01	0,70	0,41	1,05
Ausschüttungen	(0,33)	–	–	–	(0,47)	–
Schlussnettoinventarwert	7,83	10,67	11,77	10,02	5,99	11,70
Gesamtertrag	9,37 %	8,77 %	9,39 %	7,51 %	7,29 %	9,86 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,59 %	0,52 %	0,45 %	2,26 %	2,29 %	0,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,75 %	4,87 %	4,98 %	3,16 %	3,00 %	5,27 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,91	10,69	12,22	10,79	7,54	12,06
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,25	0,53	0,59	0,34	0,22	0,62
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,32)	(1,41)	(2,05)	(1,81)	(1,22)	(2,03)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,07)	(0,88)	(1,46)	(1,47)	(1,00)	(1,41)
Ausschüttungen	(0,36)	–	–	–	(0,49)	–
Schlussnettoinventarwert	7,48	9,81	10,76	9,32	6,05	10,65
Gesamtertrag	(12,11 %)	(8,23 %)	(11,95 %)	(13,62 %)	(13,51 %)	(11,69 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,65 %	0,59 %	0,52 %	2,34 %	2,34 %	0,18 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,19 %	5,24 %	5,25 %	3,43 %	3,37 %	5,63 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP P	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)
	£	£	£	£	£	£
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,65	9,93	7,75	8,39	9,33	9,85
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,51	(2,57)	0,36	0,38	0,45	0,46
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,41	3,17	0,28	0,09	0,36	0,13
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,92	0,60	0,64	0,47	0,81	0,59
Ausschüttungen	–	–	(0,34)	(0,37)	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,57	10,53	8,05	8,49	10,14	10,44
Gesamtertrag	8,64 %	6,04 %	8,63 %	5,83 %	8,68 %	5,99 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,80 %	0,73 %	0,79 %	0,79 %	0,76 %	0,76 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,63 %	(25,53 %)	4,63 %	4,63 %	4,67 %	4,65 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,71	10,26	8,95	9,09	10,26	10,18
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,55	0,48	0,41	0,44	0,48	0,51
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,61)	(0,81)	(1,22)	(0,73)	(1,41)	(0,84)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,06)	(0,33)	(0,81)	(0,29)	(0,93)	(0,33)
Ausschüttungen	–	–	(0,39)	(0,41)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,65	9,93	7,75	8,39	9,33	9,85
Gesamtertrag	(9,05 %)	(3,22 %)	(9,08 %)	(3,16 %)	(9,06 %)	(3,24 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,90 %	0,91 %	0,90 %	0,90 %	0,88 %	0,87 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,10 %	4,60 %	5,10 %	5,14 %	5,04 %	5,13 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse NOK U	Thesaurierende Klasse SEK A	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A
	£	NOK	SEK	SGD	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,54	99,75	103,59	12,31	6,26	10,49
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,63	4,48	4,17	0,49	0,26	0,44
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,45	8,16	4,71	0,66	0,43	0,76
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,08	12,64	8,88	1,15	0,69	1,20
Ausschüttungen	–	–	–	(0,79)	(0,40)	–
Schlussnettoinventarwert	12,62	112,39	112,47	12,67	6,55	11,69
Gesamtertrag	9,36 %	12,67 %	8,57 %	9,75 %	11,56 %	11,44 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,11 %	1,12 %	1,43 %	1,48 %	1,51 %	1,51 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,30 %	4,17 %	3,84 %	3,97 %	4,04 %	4,06 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,60	110,49	114,14	15,39	7,79	12,29
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,68	4,80	4,68	0,55	0,28	0,46
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,74)	(15,54)	(15,23)	(2,83)	(1,41)	(2,26)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,06)	(10,74)	(10,55)	(2,28)	(1,13)	(1,80)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,80)	(0,40)	–
Schlussnettoinventarwert	11,54	99,75	103,59	12,31	6,26	10,49
Gesamtertrag	(8,41 %)	(9,72 %)	(9,24 %)	(15,04 %)	(14,64 %)	(14,65 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,18 %	1,25 %	1,62 %	1,54 %	1,58 %	1,58 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,85 %	4,74 %	4,43 %	4,20 %	4,32 %	4,31 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1 US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I2 US$	Thesaurierende Klasse USD I5* US$	Thesaurierende Klasse USD M US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,23	9,85	7,69	7,05	10,00	8,29
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,26	0,49	0,37	0,35	0,22	0,28
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,59	0,72	0,54	0,50	0,18	0,59
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,85	1,21	0,91	0,85	0,40	0,87
Ausschüttungen	–	–	(0,35)	(0,33)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,08	11,06	8,25	7,57	10,40	9,16
Gesamtertrag	10,33 %	12,28 %	12,23 %	12,49 %	4,00 %	10,49 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	2,51 %	0,81 %	0,81 %	0,67 %	0,46 %	2,31 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,05 %	4,75 %	4,74 %	4,88 %	5,05 %	3,23 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,74	11,47	9,38	8,61	–	9,79
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,28	0,49	0,40	0,38	–	0,30
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,79)	(2,11)	(1,70)	(1,57)	–	(1,80)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,51)	(1,62)	(1,30)	(1,19)	–	(1,50)
Ausschüttungen	–	–	(0,39)	(0,37)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,23	9,85	7,69	7,05	–	8,29
Gesamtertrag	(15,50 %)	(14,12 %)	(13,98 %)	(13,96 %)	–	(15,32 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	2,58 %	0,88 %	0,88 %	0,74 %	–	2,38 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,32 %	4,78 %	4,75 %	5,13 %	–	3,48 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023		
Eröffnungsnettoinventarwert	5,94	11,70
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,19	0,67
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,40	0,86
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,59	1,53
Ausschüttungen	(0,47)	–
Schlussnettoinventarwert	6,06	13,23
Gesamtertrag	10,60 %	13,08 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen++	2,31 %	0,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,23 %	5,43 %
31. Dezember 2022		
Eröffnungsnettoinventarwert	7,56	13,52
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,22	0,68
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,37)	(2,50)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,15)	(1,82)
Ausschüttungen	(0,47)	–
Schlussnettoinventarwert	5,94	11,70
Gesamtertrag	(15,37 %)	(13,46 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen++	2,38 %	0,18 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,54 %	5,72 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

	Thesaurierende Klasse AUD I2 AUD	Thesaurierende Klasse NOK I NOK	Thesaurierende Klasse NOK I3* NOK	Thesaurierende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I2 US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,67	103,11	100,00	10,34	8,61	10,33
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,33	3,82	1,25	0,38	0,34	0,46
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,29	4,78	1,88	0,48	0,39	0,47
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,62	8,60	3,13	0,86	0,73	0,93
Schlussnettoinventarwert	9,29	111,71	103,13	11,20	9,34	11,26
Gesamtertrag	7,15 %	8,34 %	3,13 %	8,32 %	8,48 %	9,00 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,68 %	0,78 %	0,66 %	0,82 %	0,70 %	0,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,70 %	3,53 %	3,86 %	3,55 %	3,80 %	4,30 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,93	116,42	–	12,07	10,04	11,99
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,29	3,35	–	0,33	0,29	0,39
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,55)	(16,66)	–	(2,06)	(1,72)	(2,05)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,26)	(13,31)	–	(1,73)	(1,43)	(1,66)
Schlussnettoinventarwert	8,67	103,11	–	10,34	8,61	10,33
Gesamtertrag	(12,69 %)	(11,43 %)	–	(14,33 %)	(14,24 %)	(13,84 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,74 %	0,89 %	–	0,81 %	0,73 %	0,27 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,32 %	3,20 %	–	3,17 %	3,26 %	3,66 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity

	Thesaurierende Klasse AUD B	Thesaurierende Klasse AUD C2	Thesaurierende Klasse AUD E	Thesaurierende Klasse AUD T	Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse CAD I2
	AUD	AUD	AUD	AUD	CAD	CAD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,13	9,13	9,12	9,69	7,87	7,64
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,10)	(0,09)	(0,12)	(0,01)	0,07	0,08
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,39	0,39	0,41	0,43	0,31	0,44
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,29	0,30	0,29	0,42	0,38	0,52
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,18)	(0,19)
Schlussnettoinventarwert	9,42	9,43	9,41	10,11	8,07	7,97
Gesamtertrag	3,18 %	3,29 %	3,18 %	4,33 %	4,89 %	6,93 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	3,24 %	3,24 %	3,27 %	2,27 %	1,29 %	1,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,04 %)	(1,01 %)	(1,26 %)	(0,08 %)	0,91 %	1,10 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,57	12,57	12,56	13,22	9,67	10,16
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,15)	(0,16)	(0,12)	(0,02)	0,07	0,08
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(3,29)	(3,28)	(3,32)	(3,51)	(1,84)	(2,60)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,44)	(3,44)	(3,44)	(3,53)	(1,77)	(2,52)
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,03)	0,00
Schlussnettoinventarwert	9,13	9,13	9,12	9,69	7,87	7,64
Gesamtertrag	(27,37 %)	(27,37 %)	(27,39 %)	(26,70 %)	(18,34 %)	(24,79 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	3,35 %	3,35 %	3,35 %	2,33 %	1,33 %	1,12 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,42 %)	(1,52 %)	(1,22 %)	(0,21 %)	0,82 %	1,01 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR Z €	Thesaurierende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP Z £	Thesaurierende Klasse USD A US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,60	9,87	7,33	9,77	11,72	9,44
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,07	(0,10)	0,14	0,09	0,23	(0,01)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,37	0,40	0,31	0,57	0,70	0,65
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,44	0,30	0,45	0,66	0,93	0,64
Schlussnettoinventarwert	9,04	10,17	7,78	10,43	12,65	10,08
Gesamtertrag	5,12 %	3,04 %	6,14 %	6,76 %	7,94 %	6,78 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,29 %	3,26 %	0,31 %	1,29 %	0,31 %	2,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,83 %	(1,05 %)	1,89 %	0,92 %	1,89 %	(0,06 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,68	13,67	9,85	13,06	15,52	12,53
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,05	(0,14)	0,14	0,08	0,18	(0,02)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(3,13)	(3,66)	(2,66)	(3,37)	(3,98)	(3,07)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,08)	(3,80)	(2,52)	(3,29)	(3,80)	(3,09)
Schlussnettoinventarwert	8,60	9,87	7,33	9,77	11,72	9,44
Gesamtertrag	(26,37 %)	(27,80 %)	(25,58 %)	(25,19 %)	(24,48 %)	(24,66 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,26 %	3,23 %	0,27 %	1,31 %	0,28 %	2,28 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,47 %	(1,26 %)	1,72 %	0,76 %	1,30 %	(0,20 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD B US$	Thesaurierende Klasse USD C2 US$	Thesaurierende Klasse USD E US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD T US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,96	9,95	9,94	10,66	10,60	10,57
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,11)	(0,23)	(0,08)	0,08	(0,11)	(0,03)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,67	0,78	0,64	0,74	0,71	0,75
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,56	0,55	0,56	0,82	0,60	0,72
Schlussnettoinventarwert	10,52	10,50	10,50	11,48	11,20	11,29
Gesamtertrag	5,62 %	5,53 %	5,63 %	7,69 %	5,66 %	6,81 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	3,33 %	3,53 %	3,31 %	1,33 %	3,34 %	2,33 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,10 %)	(2,25 %)	(0,77 %)	0,75 %	(1,05 %)	(0,29 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,34	13,33	13,33	14,00	14,21	14,04
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,15)	(0,15)	(0,12)	0,09	(0,15)	0,01
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(3,23)	(3,23)	(3,27)	(3,43)	(3,46)	(3,48)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,38)	(3,38)	(3,39)	(3,34)	(3,61)	(3,47)
Schlussnettoinventarwert	9,96	9,95	9,94	10,66	10,60	10,57
Gesamtertrag	(25,34 %)	(25,36 %)	(25,43 %)	(23,86 %)	(25,40 %)	(24,72 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	3,28 %	3,28 %	3,28 %	1,28 %	3,28 %	2,29 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,35 %)	(1,36 %)	(1,15 %)	0,79 %	(1,30 %)	0,12 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US$	Thesaurierende Klasse ZAR B ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR C2 ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR
31. Dezember 2023					
Eröffnungsnettoinventarwert	10,94	121,51	121,50	121,51	129,33
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,22	(1,19)	(2,96)	(1,34)	(0,14)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,75	10,71	12,46	10,85	11,67
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,97	9,52	9,50	9,51	11,53
Schlussnettoinventarwert	11,91	131,03	131,00	131,02	140,86
Gesamtertrag	8,87 %	7,83 %	7,82 %	7,83 %	8,92 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen[++]	0,32 %	3,31 %	3,63 %	3,31 %	2,30 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,93 %	(0,95 %)	(2,32 %)	(1,06 %)	(0,10 %)
31. Dezember 2022					
Eröffnungsnettoinventarwert	14,23	159,43	159,42	159,43	168,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,19	(2,17)	(2,29)	(1,88)	(0,27)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(3,48)	(35,75)	(35,63)	(36,04)	(38,40)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,29)	(37,92)	(37,92)	(37,92)	(38,67)
Schlussnettoinventarwert	10,94	121,51	121,50	121,51	129,33
Gesamtertrag	(23,12 %)	(23,78 %)	(23,79 %)	(23,78 %)	(23,02 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen[++]	0,28 %	3,41 %	3,41 %	3,41 %	2,37 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,57 %	(1,58 %)	(1,67 %)	(1,41 %)	(0,20 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €
31. Dezember 2023		
Eröffnungsnettoinventarwert	9,96	9,41
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,27	0,24
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,72	0,68
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,99	0,92
Ausschüttungen	–	(0,20)
Schlussnettoinventarwert	10,95	10,13
Gesamtertrag	9,94 %	9,96 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	0,57 %	0,56 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,60 %	2,54 %
31. Dezember 2022		
Eröffnungsnettoinventarwert	11,80	11,42
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,29	0,25
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,13)	(2,03)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,84)	(1,78)
Ausschüttungen	–	(0,23)
Schlussnettoinventarwert	9,96	9,41
Gesamtertrag	(15,59 %)	(15,68 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	0,57 %	0,57 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,75 %	2,48 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I5 €	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023				
Eröffnungsnettoinventarwert	10,52	10,04	10,55	10,86
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,26	0,24	0,27	0,33
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,60	0,56	0,61	0,85
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,86	0,80	0,88	1,18
Ausschüttungen	–	(0,17)	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,38	10,67	11,43	12,04
Gesamtertrag	8,17 %	8,10 %	8,34 %	10,87 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	0,67 %	0,66 %	0,45 %	0,23 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,39 %	2,38 %	2,54 %	2,89 %
31. Dezember 2022				
Eröffnungsnettoinventarwert	11,04	10,73	11,04	11,11
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,21	0,21	0,24	0,28
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,73)	(0,70)	(0,73)	(0,53)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,52)	(0,49)	(0,49)	(0,25)
Ausschüttungen	–	(0,20)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,52	10,04	10,55	10,86
Gesamtertrag	(4,71 %)	(4,58 %)	(4,44 %)	(2,25 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	0,68 %	0,69 %	0,46 %	0,24 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,97 %	2,08 %	2,26 %	2,58 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

	Thesaurierende Klasse CHF I* CHF	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2* €	Thesaurierende Klasse EUR I5* €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR X €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	12,34	10,00	10,00	11,31	10,82
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,34	0,58	0,07	0,05	0,37	0,56
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,41	1,09	0,47	0,39	1,00	0,95
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,75	1,67	0,54	0,44	1,37	1,51
Schlussnettoinventarwert	10,75	14,01	10,54	10,44	12,68	12,33
Gesamtertrag	7,50 %	13,53 %	5,40 %	4,40 %	12,11 %	13,96 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,79 %	0,82 %	0,72 %	0,48 %	2,01 %	0,42 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,15 %	4,39 %	4,91 %	4,82 %	3,08 %	4,81 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	13,64	–	–	12,65	11,91
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	–	0,46	–	–	0,29	0,45
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	–	(1,76)	–	–	(1,63)	(1,54)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	(1,30)	–	–	(1,34)	(1,09)
Schlussnettoinventarwert	–	12,34	–	–	11,31	10,82
Gesamtertrag	–	(9,53 %)	–	–	(10,59 %)	(9,15 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	–	0,81 %	–	–	2,01 %	0,41 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	3,68 %	–	–	2,49 %	4,07 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR Y*	Ausschüttende Klasse EUR Y	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Z
	€	€	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	8,63	14,23	11,95	11,25
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,52	0,25	0,33	0,66	0,63	0,60
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,78	0,61	0,93	1,60	1,32	1,26
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,30	0,86	1,26	2,26	1,95	1,86
Ausschüttungen	–	(0,12)	(0,64)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,30	10,74	9,25	16,49	13,90	13,11
Gesamtertrag	13,00 %	8,72 %	15,17 %	15,88 %	16,32 %	16,53 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,31 %	0,31 %	1,44 %	0,83 %	0,43 %	0,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,92 %	4,79 %	3,74 %	4,36 %	4,94 %	4,98 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	–	9,97	15,39	12,87	12,09
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	–	–	0,27	0,53	0,48	0,49
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	–	–	(1,08)	(1,69)	(1,40)	(1,33)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	–	(0,81)	(1,16)	(0,92)	(0,84)
Ausschüttungen	–	–	(0,53)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	–	–	8,63	14,23	11,95	11,25
Gesamtertrag	–	–	(8,12 %)	(7,54 %)	(7,15 %)	(6,95 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	–	–	1,43 %	0,82 %	0,42 %	0,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	–	3,04 %	3,72 %	4,05 %	4,33 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity

	Ausschüttende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR I5 €	Thesaurierende Klasse EUR M €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,93	9,11	9,09	7,79	7,96	8,83
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,04)	0,05	0,05	0,06	0,07	(0,12)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,45	1,68	1,67	1,42	1,46	1,62
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,41	1,73	1,72	1,48	1,53	1,50
Ausschüttungen	–	–	(0,06)	(0,06)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,34	10,84	10,75	9,21	9,49	10,33
Gesamtertrag	17,78 %	18,99 %	19,00 %	19,19 %	19,22 %	16,99 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,64 %	0,75 %	0,72 %	0,57 %	0,45 %	2,45 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,41 %)	0,52 %	0,55 %	0,65 %	0,81 %	(1,24 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	12,14	12,15	10,37	10,57	11,97
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,02)	0,05	0,07	0,06	0,08	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,05)	(3,08)	(3,10)	(2,64)	(2,69)	(3,04)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,07)	(3,03)	(3,03)	(2,58)	(2,61)	(3,14)
Ausschüttungen	–	–	(0,03)	0,00	–	–
Schlussnettoinventarwert	7,93	9,11	9,09	7,79	7,96	8,83
Gesamtertrag	(20,70 %)	(24,96 %)	(25,02 %)	(24,86 %)	(24,69 %)	(26,23 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,66 %	0,75 %	0,75 %	0,59 %	0,46 %	2,46 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,24 %)	0,53 %	0,68 %	0,72 %	0,89 %	(1,10 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR Z	Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)
	€	US$	US$	US$
31. Dezember 2023				
Eröffnungsnettoinventarwert	9,12	8,03	8,15	7,91
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,12	(0,03)	(0,04)	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,68	1,80	1,93	1,77
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,80	1,77	1,89	1,67
Schlussnettoinventarwert	10,92	9,80	10,04	9,58
Gesamtertrag	19,74 %	22,04 %	23,19 %	21,11 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	0,15 %	1,66 %	0,75 %	2,48 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,17 %	(0,37 %)	(0,43 %)	(1,18 %)
31. Dezember 2022				
Eröffnungsnettoinventarwert	12,09	11,50	11,58	11,43
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,00	(0,02)	0,05	(0,09)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,97)	(3,45)	(3,48)	(3,43)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,97)	(3,47)	(3,43)	(3,52)
Schlussnettoinventarwert	9,12	8,03	8,15	7,91
Gesamtertrag	(24,57 %)	(30,17 %)	(29,62 %)	(30,80 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	0,29 %	1,64 %	0,77 %	2,46 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,03 %)	(0,27 %)	0,60 %	(1,08 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Event Driven[2]

	Thesaurierende Klasse EUR I* €	Thesaurierende Klasse GBP I5 £	Ausschüttende Klasse GBP I5 £	Thesaurierende Klasse GBP P £	Thesaurierende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I5 US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,11	10,11	10,10	10,12	10,13
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,05)	(0,17)	(0,12)	(0,18)	(0,31)	(0,16)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,36	0,60	0,56	0,58	0,74	0,64
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,31	0,43	0,44	0,40	0,43	0,48
Schlussnettoinventarwert	10,31	10,54	10,55	10,50	10,55	10,61
Gesamtertrag	3,10 %	4,25 %	4,35 %	3,96 %	4,25 %	4,74 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,23 %	2,28 %	1,78 %	2,35 %	3,55 %	2,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,55 %)	(1,65 %)	(1,15 %)	(1,73 %)	(3,06 %)	(1,58 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	–	(0,02)	(0,02)	(0,03)	(0,04)	(0,02)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	–	0,13	0,13	0,13	0,16	0,15
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	0,11	0,11	0,10	0,12	0,13
Schlussnettoinventarwert	–	10,11	10,11	10,10	10,12	10,13
Gesamtertrag	–	1,10 %	1,10 %	1,00 %	1,20 %	1,30 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	–	1,76 %	1,72 %	2,42 %	2,70 %	1,94 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	(1,13 %)	(1,10 %)	(1,79 %)	(2,07 %)	(1,30 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Bond

	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse*	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD M
	AUD	€	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,44	10,00	8,57	10,18	9,63	9,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,19	0,11	0,18	0,35	0,32	0,25
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,11	0,29	0,27	0,45	0,31	0,29
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,30	0,40	0,45	0,80	0,63	0,54
Ausschüttungen	(0,21)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	7,53	10,40	9,02	10,98	10,26	9,54
Gesamtertrag	4,22 %	4,00 %	5,25 %	7,86 %	6,54 %	6,00 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,94 %	0,41 %	1,61 %	0,36 %	0,41 %	1,01 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,65 %	3,38 %	2,07 %	3,33 %	3,34 %	2,73 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,22	–	10,29	10,00	11,42	10,76
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,11	–	0,06	0,07	0,20	0,09
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,69)	–	(1,78)	0,11	(1,99)	(1,85)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,58)	–	(1,72)	0,18	(1,79)	(1,76)
Ausschüttungen	(0,20)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	7,44	–	8,57	10,18	9,63	9,00
Gesamtertrag	(17,25 %)	–	(16,72 %)	1,80 %	(15,67 %)	(16,36 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,12 %	–	1,83 %	0,62 %	0,52 %	1,41 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,42 %	–	0,63 %	2,48 %	1,97 %	0,95 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich) US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich) ZAR
31. Dezember 2023			
Eröffnungsnettoinventarwert	7,67	10,10	75,50
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,21	0,35	2,01
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,24	0,34	4,31
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,45	0,69	6,32
Ausschüttungen	(0,22)	–	(4,79)
Schlussnettoinventarwert	7,90	10,79	77,03
Gesamtertrag	6,03 %	6,83 %	8,79 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	0,97 %	0,22 %	0,96 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,72 %	3,46 %	2,69 %
31. Dezember 2022			
Eröffnungsnettoinventarwert	9,38	11,94	92,85
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,11	0,24	1,16
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,61)	(2,08)	(13,12)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,50)	(1,84)	(11,96)
Ausschüttungen	(0,21)	–	(5,39)
Schlussnettoinventarwert	7,67	10,10	75,50
Gesamtertrag	(16,15 %)	(15,41 %)	(13,12 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	1,10 %	0,21 %	1,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,39 %	2,26 %	1,43 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024

	Thesaurierende Klasse EUR A €	Ausschüttende Klasse EUR A €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse GBP I £	Ausschüttende Klasse HKD A HKD	Ausschüttende Klasse SGD A SGD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,67	8,94	8,83	9,16	9,08	18,40
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,31	0,28	0,31	0,32	0,29	0,58
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,01	0,00	0,01	0,16	0,11	0,16
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,32	0,28	0,32	0,48	0,40	0,74
Ausschüttungen	–	(0,30)	(0,33)	(0,34)	(0,31)	(0,62)
Schlussnettoinventarwert	9,99	8,92	8,82	9,30	9,17	18,52
Gesamtertrag	3,31 %	3,20 %	3,72 %	5,42 %	4,48 %	4,11 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,89 %	0,89 %	0,50 %	0,50 %	0,91 %	0,90 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,15 %	3,15 %	3,55 %	3,53 %	3,21 %	3,18 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,33	9,90	9,79	9,99	9,90	20,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,35	0,32	0,36	0,38	0,33	0,65
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,01)	(0,94)	(0,94)	(0,82)	(0,81)	(1,56)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,66)	(0,62)	(0,58)	(0,44)	(0,48)	(0,91)
Ausschüttungen	–	(0,34)	(0,38)	(0,39)	(0,34)	(0,69)
Schlussnettoinventarwert	9,67	8,94	8,83	9,16	9,08	18,40
Gesamtertrag	(6,39 %)	(6,28 %)	(6,00 %)	(4,41 %)	(4,88 %)	(4,56 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,87 %	0,87 %	0,47 %	0,49 %	0,88 %	0,86 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,51 %	3,51 %	3,91 %	4,06 %	3,56 %	3,47 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A US$	Ausschüttende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD X US$	Ausschüttende Klasse USD X US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,01	9,23	10,11	9,23	10,10	9,24
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,33	0,30	0,38	0,34	0,37	0,33
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,22	0,18	0,21	0,19	0,22	0,19
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,55	0,48	0,59	0,53	0,59	0,52
Ausschüttungen	–	(0,31)	–	(0,35)	–	(0,35)
Schlussnettoinventarwert	10,56	9,40	10,70	9,41	10,69	9,41
Gesamtertrag	5,49 %	5,35 %	5,84 %	5,89 %	5,84 %	5,72 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,91 %	0,91 %	0,51 %	0,51 %	0,56 %	0,56 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,23 %	3,23 %	3,62 %	3,62 %	3,57 %	3,57 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,47	10,00	10,53	10,01	10,53	10,01
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,36	0,33	0,40	0,37	0,40	0,37
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,82)	(0,76)	(0,82)	(0,77)	(0,83)	(0,76)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,46)	(0,43)	(0,42)	(0,40)	(0,43)	(0,39)
Ausschüttungen	–	(0,34)	–	(0,38)	–	(0,38)
Schlussnettoinventarwert	10,01	9,23	10,11	9,23	10,10	9,24
Gesamtertrag	(4,39 %)	(4,28 %)	(3,99 %)	(3,99 %)	(4,08 %)	(3,94 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,88 %	0,88 %	0,48 %	0,48 %	0,53 %	0,53 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,57 %	3,57 %	3,96 %	3,97 %	3,92 %	3,91 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

	Thesaurierende Klasse EUR I*	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse SGD A*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1
	€	€	£	SGD	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	13,68	10,00	20,00	12,43	11,87
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,00	(0,23)	0,01	0,00	(0,11)	(0,24)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,05)	2,54	0,62	0,85	2,83	2,70
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,05)	2,31	0,63	0,85	2,72	2,46
Schlussnettoinventarwert	9,95	15,99	10,63	20,85	15,15	14,33
Gesamtertrag	(0,50 %)	16,89 %	6,30 %	4,25 %	21,88 %	20,72 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,07 %	2,70 %	1,04 %	2,02 %	1,96 %	2,95 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,91 %	(1,56 %)	0,14 %	0,12 %	(0,81 %)	(1,83 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	15,15	–	–	14,54	14,03
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	–	(0,25)	–	–	(0,13)	(0,25)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	–	(1,22)	–	–	(1,98)	(1,91)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	(1,47)	–	–	(2,11)	(2,16)
Schlussnettoinventarwert	–	13,68	–	–	12,43	11,87
Gesamtertrag	–	(9,70 %)	–	–	(14,51 %)	(15,40 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	–	2,74 %	–	–	1,98 %	2,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	(1,72 %)	–	–	(0,99 %)	(2,00 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023			
Eröffnungsnettoinventarwert	13,01	11,90	8,77
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,02	(0,21)	0,10
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	2,96	2,70	2,00
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,98	2,49	2,10
Schlussnettoinventarwert	15,99	14,39	10,87
Gesamtertrag	22,91 %	20,92 %	23,95 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	1,11 %	2,75 %	0,26 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,14 %	(1,62 %)	0,96 %
31. Dezember 2022			
Eröffnungsnettoinventarwert	15,09	14,04	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,02)	(0,23)	0,05
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(2,06)	(1,91)	(1,28)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,08)	(2,14)	(1,23)
Schlussnettoinventarwert	13,01	11,90	8,77
Gesamtertrag	(13,78 %)	(15,24 %)	(12,30 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	1,14 %	2,78 %	0,25 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,13 %)	(1,80 %)	0,67 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income

	Thesaurierende Klasse CAD I5 CAD	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse GBP I5 £	Thesaurierende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD I US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,34	9,69	9,25	10,49	9,74	10,54
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,55	0,54	0,38	0,62	0,50	0,61
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,58	0,43	0,42	0,65	0,65	0,71
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,13	0,97	0,80	1,27	1,15	1,32
Schlussnettoinventarwert	10,47	10,66	10,05	11,76	10,89	11,86
Gesamtertrag	12,10 %	10,01 %	8,65 %	12,11 %	11,81 %	12,52 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,41 %	0,70 %	2,08 %	0,41 %	1,32 %	0,72 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,68 %	5,38 %	4,03 %	5,67 %	4,92 %	5,52 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,39	11,01	10,67	11,70	10,88	11,70
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,52	0,49	0,33	0,57	0,43	0,53
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,57)	(1,81)	(1,75)	(1,78)	(1,57)	(1,69)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,05)	(1,32)	(1,42)	(1,21)	(1,14)	(1,16)
Schlussnettoinventarwert	9,34	9,69	9,25	10,49	9,74	10,54
Gesamtertrag	(10,11 %)	(11,99 %)	(13,31 %)	(10,34 %)	(10,48 %)	(9,91 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,41 %	0,69 %	2,07 %	0,41 %	1,30 %	0,70 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,46 %	4,89 %	3,48 %	5,31 %	4,36 %	4,97 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023			
Eröffnungsnettoinventarwert	9,53	9,56	10,70
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,53	0,41	0,69
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,61	0,63	0,72
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,14	1,04	1,41
Ausschüttungen	(0,52)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,15	10,60	12,11
Gesamtertrag	12,43 %	10,88 %	13,18 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	0,72 %	2,12 %	0,12 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,52 %	4,12 %	6,11 %
31. Dezember 2022			
Eröffnungsnettoinventarwert	11,09	10,76	11,81
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,49	0,34	0,59
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,58)	(1,54)	(1,70)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,09)	(1,20)	(1,11)
Ausschüttungen	(0,47)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,53	9,56	10,70
Gesamtertrag	(9,89 %)	(11,15 %)	(9,40 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	0,70 %	2,10 %	0,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,93 %	3,54 %	5,40 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global SDG Engagement

	Ausschüttende Klasse AUD I AUD	Thesaurierende Klasse CHF I4 CHF	Ausschüttende Klasse CHF I4 CHF	Thesaurierende Klasse CHF X CHF	Thesaurierende Klasse EUR I4 €	Ausschüttende Klasse EUR I4 €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,36	9,53	9,32	9,49	9,51	9,30
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,48	0,50	0,47	0,43	0,53	0,50
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,29	0,08	0,07	0,08	0,25	0,22
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,77	0,58	0,54	0,51	0,78	0,72
Ausschüttungen	(0,48)	–	(0,50)	–	–	(0,50)
Schlussnettoinventarwert	9,65	10,11	9,36	10,00	10,29	9,52
Gesamtertrag	8,54 %	6,09 %	6,10 %	5,37 %	8,20 %	8,10 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,70 %	0,45 %	0,45 %	1,14 %	0,47 %	0,47 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,12 %	5,18 %	5,18 %	4,47 %	5,39 %	5,39 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,32	0,32	0,32	0,28	0,32	0,32
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,89)	(0,79)	(0,79)	(0,79)	(0,81)	(0,81)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,57)	(0,47)	(0,47)	(0,51)	(0,49)	(0,49)
Ausschüttungen	(0,07)	–	(0,21)	–	–	(0,21)
Schlussnettoinventarwert	9,36	9,53	9,32	9,49	9,51	9,30
Gesamtertrag	(5,65 %)	(4,70 %)	(4,70 %)	(5,10 %)	(4,90 %)	(4,87 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,71 %	0,46 %	0,46 %	1,16 %	0,46 %	0,46 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,09 %	5,03 %	5,05 %	4,41 %	5,03 %	5,05 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR X €	Thesaurierende Klasse EUR Z (PF) €	Thesaurierende Klasse GBP I4 £	Thesaurierende Klasse GBP X £	Thesaurierende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD I US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,46	10,68	9,63	9,59	11,29	11,86
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,45	0,62	0,54	0,46	0,54	0,66
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,25	0,28	0,42	0,41	0,55	0,56
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,70	0,90	0,96	0,87	1,09	1,22
Schlussnettoinventarwert	10,16	11,58	10,59	10,46	12,38	13,08
Gesamtertrag	7,40 %	8,43 %	9,97 %	9,07 %	9,65 %	10,29 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,19 %	0,21 %	0,47 %	1,18 %	1,31 %	0,71 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,66 %	5,64 %	5,40 %	4,65 %	4,61 %	5,35 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	12,25	10,00	10,00	12,78	13,35
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,28	0,61	0,33	0,29	0,51	0,61
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,82)	(2,18)	(0,70)	(0,70)	(2,00)	(2,10)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,54)	(1,57)	(0,37)	(0,41)	(1,49)	(1,49)
Schlussnettoinventarwert	9,46	10,68	9,63	9,59	11,29	11,86
Gesamtertrag	(5,40 %)	(12,82 %)	(3,70 %)	(4,10 %)	(11,66 %)	(11,16 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,16 %	0,24 %	0,47 %	1,20 %	1,34 %	0,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,41 %	5,46 %	5,19 %	4,55 %	4,42 %	5,02 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I4 US$	Ausschüttende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD X US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023				
Eröffnungsnettoinventarwert	9,70	7,72	9,53	12,32
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,55	0,31	0,47	0,75
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,48	0,35	0,46	0,61
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,03	0,66	0,93	1,36
Ausschüttungen	–	(0,46)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,73	7,92	10,46	13,68
Gesamtertrag	10,62 %	8,93 %	9,76 %	11,04 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	0,48 %	1,91 %	1,21 %	0,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,51 %	4,06 %	4,76 %	5,86 %
31. Dezember 2022				
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	9,32	10,76	13,79
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,34	0,31	0,46	0,71
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,64)	(1,43)	(1,69)	(2,18)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,30)	(1,12)	(1,23)	(1,47)
Ausschüttungen	–	(0,48)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,70	7,72	9,53	12,32
Gesamtertrag	(3,00 %)	(12,19 %)	(11,43 %)	(10,66 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	0,48 %	1,94 %	1,08 %	0,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,33 %	3,83 %	4,74 %	5,66 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit

	Thesaurierende Klasse EUR I* €	Thesaurierende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD X US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023				
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	8,44	8,46	8,47
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,17	0,32	0,34	0,35
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,34	0,49	0,49	0,49
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,51	0,81	0,83	0,84
Schlussnettoinventarwert	10,51	9,25	9,29	9,31
Gesamtertrag	5,10 %	9,60 %	9,81 %	9,92 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen++	0,45 %	0,47 %	0,27 %	0,17 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,94 %	3,72 %	3,90 %	4,01 %
31. Dezember 2022				
Eröffnungsnettoinventarwert	–	9,88	9,88	9,89
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	–	0,26	0,26	0,27
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	–	(1,70)	(1,68)	(1,69)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	(1,44)	(1,42)	(1,42)
Schlussnettoinventarwert	–	8,44	8,46	8,47
Gesamtertrag	–	(14,57 %)	(14,37 %)	(14,36 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen++	–	0,46 %	0,25 %	0,15 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	3,16 %	2,92 %	3,02 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse GBP P £	Thesaurierende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I2 US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,72	9,31	10,22	10,91	9,50	10,32
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,31	0,36	0,38	0,43	0,36	0,41
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,65	0,16	0,23	0,25	0,22	0,24
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,96	0,52	0,61	0,68	0,58	0,65
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,28)	–
Schlussnettoinventarwert	9,68	9,83	10,83	11,59	9,80	10,97
Gesamtertrag	11,01 %	5,59 %	5,97 %	6,23 %	6,30 %	6,30 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,51 %	0,49 %	0,82 %	0,51 %	0,51 %	0,45 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,47 %	3,76 %	3,63 %	3,83 %	3,81 %	3,91 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,08	10,59	11,59	12,32	11,02	11,65
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,28	0,32	0,29	0,34	0,32	0,35
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,64)	(1,60)	(1,66)	(1,75)	(1,58)	(1,68)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,36)	(1,28)	(1,37)	(1,41)	(1,26)	(1,33)
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,26)	–
Schlussnettoinventarwert	8,72	9,31	10,22	10,91	9,50	10,32
Gesamtertrag	(13,49 %)	(12,09 %)	(11,82 %)	(11,44 %)	(11,52 %)	(11,42 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,57 %	0,58 %	0,94 %	0,60 %	0,58 %	0,51 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,13 %	3,26 %	2,76 %	2,96 %	3,18 %	3,25 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023	
Eröffnungsnettoinventarwert	10,04
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,42
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,24
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,66
Schlussnettoinventarwert	10,70
Gesamtertrag	6,57 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen++	0,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,14 %
31. Dezember 2022	
Eröffnungsnettoinventarwert	11,31
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,37
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,64)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,27)
Schlussnettoinventarwert	10,04
Gesamtertrag	(11,23 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen++	0,23 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,54 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities

	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP Z	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD CI	Thesaurierende Klasse USD I
	€	€	£	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,87	11,25	11,37	9,83	8,77	12,55
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,05	0,34	0,34	0,15	0,05	0,28
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,25	0,20	0,50	0,53	0,46	0,68
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,30	0,54	0,84	0,68	0,51	0,96
Schlussnettoinventarwert	10,17	11,79	12,21	10,51	9,28	13,51
Gesamtertrag	3,04 %	4,80 %	7,39 %	6,92 %	5,82 %	7,65 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,75 %	0,31 %	0,31 %	1,82 %	2,82 %	1,06 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,51 %	3,07 %	2,97 %	1,49 %	0,55 %	2,23 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,96	14,07	15,48	13,30	11,98	16,86
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,01)	0,30	0,32	0,10	(0,01)	0,24
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(4,08)	(3,12)	(4,43)	(3,57)	(3,20)	(4,55)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,09)	(2,82)	(4,11)	(3,47)	(3,21)	(4,31)
Schlussnettoinventarwert	9,87	11,25	11,37	9,83	8,77	12,55
Gesamtertrag	(29,30 %)	(20,04 %)	(26,55 %)	(26,09 %)	(26,79 %)	(25,56 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,77 %	0,31 %	0,32 %	1,82 %	2,82 %	1,07 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,11 %)	2,38 %	2,44 %	0,87 %	(0,12 %)	1,69 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I5 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023			
Eröffnungsnettoinventarwert	8,82	8,99	12,81
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,21	0,05	0,39
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,49	0,47	0,69
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,70	0,52	1,08
Ausschüttungen	(0,21)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,31	9,51	13,89
Gesamtertrag	8,14 %	5,78 %	8,43 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	0,69 %	2,82 %	0,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,39 %	0,55 %	3,01 %
31. Dezember 2022			
Eröffnungsnettoinventarwert	12,03	12,29	17,07
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,20	(0,03)	0,34
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(3,22)	(3,27)	(4,60)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,02)	(3,30)	(4,26)
Ausschüttungen	(0,19)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,82	8,99	12,81
Gesamtertrag	(25,27 %)	(26,85 %)	(24,96 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	0,69 %	2,82 %	0,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,02 %	(0,29 %)	2,40 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity

	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD A
	€	€	€	£	£	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,10	9,73	9,75	9,85	9,90	7,28
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,02	(0,18)	0,05	(0,01)	0,02	(0,08)
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,99	1,88	1,92	1,65	1,67	1,72
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,01	1,70	1,97	1,64	1,69	1,64
Schlussnettoinventarwert	12,11	11,43	11,72	11,49	11,59	8,92
Gesamtertrag	19,90 %	17,47 %	20,21 %	16,65 %	17,07 %	22,53 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,47 %	2,43 %	0,17 %	0,76 %	0,47 %	1,67 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,22 %	(1,75 %)	0,51 %	(0,08 %)	0,21 %	(0,97 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,18	12,96	12,68	12,20	12,22	10,24
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,02	(0,19)	0,05	(0,01)	0,02	(0,07)
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(3,10)	(3,04)	(2,98)	(2,34)	(2,34)	(2,89)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,08)	(3,23)	(2,93)	(2,35)	(2,32)	(2,96)
Schlussnettoinventarwert	10,10	9,73	9,75	9,85	9,90	7,28
Gesamtertrag	(23,37 %)	(24,92 %)	(23,11 %)	(19,26 %)	(18,99 %)	(28,91 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,43 %	2,40 %	0,14 %	0,77 %	0,45 %	1,64 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,19 %	(1,80 %)	0,46 %	(0,06 %)	0,21 %	(0,95 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023				
Eröffnungsnettoinventarwert	8,83	8,84	8,54	8,32
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,01)	(0,01)	(0,17)	0,05
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	2,11	2,11	2,01	1,98
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,10	2,10	1,84	2,03
Schlussnettoinventarwert	10,93	10,94	10,38	10,35
Gesamtertrag	23,78 %	23,76 %	21,55 %	24,40 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen++	0,78 %	0,75 %	2,48 %	0,18 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,08 %)	(0,06 %)	(1,78 %)	0,51 %
31. Dezember 2022				
Eröffnungsnettoinventarwert	12,33	12,33	12,10	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,01)	(0,01)	(0,18)	0,01
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(3,49)	(3,48)	(3,38)	(1,69)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,50)	(3,49)	(3,56)	(1,68)
Schlussnettoinventarwert	8,83	8,84	8,54	8,32
Gesamtertrag	(28,39 %)	(28,30 %)	(29,42 %)	(16,80 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen++	0,74 %	0,73 %	2,42 %	0,20 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,13 %)	(0,10 %)	(1,81 %)	0,20 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value

	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I3
	€	£	£	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	14,02	10,08	10,00	15,83	16,71	9,47
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,08	0,21	0,02	0,23	0,32	0,19
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	1,66	0,83	0,68	2,33	2,47	1,40
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,74	1,04	0,70	2,56	2,79	1,59
Schlussnettoinventarwert	15,76	11,12	10,70	18,39	19,50	11,06
Gesamtertrag	12,41 %	10,32 %	7,00 %	16,17 %	16,70 %	16,79 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,97 %	0,51 %	0,72 %	1,21 %	0,77 %	0,63 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,53 %	1,98 %	1,06 %	1,37 %	1,77 %	1,91 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	16,86	10,00	–	18,26	19,19	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,08	0,05	–	0,22	0,35	0,10
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(2,92)	0,03	–	(2,65)	(2,83)	(0,63)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,84)	0,08	–	(2,43)	(2,48)	(0,53)
Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	14,02	10,08	–	15,83	16,71	9,47
Gesamtertrag	(16,84 %)	0,80 %	–	(13,31 %)	(12,92 %)	(5,30 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,98 %	0,53 %	–	1,22 %	0,76 %	0,64 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,51 %	1,80 %	–	1,39 %	2,08 %	1,80 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023	
Eröffnungsnettoinventarwert	18,15
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,44
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	2,69
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,13
Schlussnettoinventarwert	21,28
Gesamtertrag	17,25 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,31 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,29 %
31. Dezember 2022	
Eröffnungsnettoinventarwert	20,75
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,42
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(3,02)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,60)
Schlussnettoinventarwert	18,15
Gesamtertrag	(12,53 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,27 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD A AUD	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD B AUD	Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) AUD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	6,43	13,78	4,95	8,71	4,96	5,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,34	0,76	0,18	0,34	0,19	0,19
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,20	0,46	0,16	0,28	0,15	0,15
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,54	1,22	0,34	0,62	0,34	0,34
Ausschüttungen	(0,47)	–	(0,36)	–	(0,36)	(0,37)
Schlussnettoinventarwert	6,50	15,00	4,93	9,33	4,94	4,97
Gesamtertrag	8,87 %	8,85 %	7,27 %	7,12 %	7,27 %	7,06 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,29 %	1,29 %	2,86 %	2,84 %	2,91 %	2,86 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,33 %	5,33 %	3,77 %	3,76 %	3,78 %	3,77 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,91	15,93	6,24	10,24	6,25	6,30
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,34	0,71	0,18	0,30	0,18	0,18
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,39)	(2,86)	(1,09)	(1,83)	(1,09)	(1,09)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,05)	(2,15)	(0,91)	(1,53)	(0,91)	(0,91)
Ausschüttungen	(0,43)	–	(0,38)	–	(0,38)	(0,39)
Schlussnettoinventarwert	6,43	13,78	4,95	8,71	4,96	5,00
Gesamtertrag	(13,52 %)	(13,50 %)	(14,90 %)	(14,94 %)	(14,87 %)	(14,86 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,33 %	1,34 %	2,97 %	2,97 %	2,97 %	2,97 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,88 %	4,86 %	3,20 %	3,24 %	3,16 %	3,14 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse AUD E	Ausschüttende Klasse AUD I	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	Thesaurierende Klasse AUD T	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)
	AUD	AUD	AUD	AUD	AUD	CAD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,82	9,15	5,71	5,52	11,83	6,61
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,38	0,54	0,27	0,26	0,57	0,35
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,32	0,29	0,18	0,17	0,40	0,27
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,70	0,83	0,45	0,43	0,97	0,62
Ausschüttungen	–	(0,54)	(0,42)	(0,40)	–	(0,49)
Schlussnettoinventarwert	10,52	9,44	5,74	5,55	12,80	6,74
Gesamtertrag	7,13 %	9,56 %	8,27 %	8,16 %	8,20 %	9,80 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,86 %	0,70 %	1,87 %	1,87 %	1,87 %	1,29 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,77 %	5,92 %	4,74 %	4,74 %	4,73 %	5,34 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,54	11,10	7,13	6,89	13,75	8,06
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,33	0,54	0,27	0,26	0,53	0,35
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,05)	(1,96)	(1,25)	(1,21)	(2,45)	(1,36)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,72)	(1,42)	(0,98)	(0,95)	(1,92)	(1,01)
Ausschüttungen	–	(0,53)	(0,44)	(0,42)	–	(0,44)
Schlussnettoinventarwert	9,82	9,15	5,71	5,52	11,83	6,61
Gesamtertrag	(14,90 %)	(13,01 %)	(14,09 %)	(14,08 %)	(13,96 %)	(12,76 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,98 %	0,73 %	1,95 %	1,95 %	1,94 %	1,36 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,01 %	5,39 %	4,27 %	4,25 %	4,38 %	4,96 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse CHF A	Thesaurierende Klasse CHF I	Thesaurierende Klasse CHF I2	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)
	CHF	CHF	CHF	CNY	CNY	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,47	12,22	10,47	73,25	77,39	6,03
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,60	0,67	0,62	3,96	4,63	0,32
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,11	0,17	0,11	1,31	1,41	0,15
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,71	0,84	0,73	5,27	6,04	0,47
Ausschüttungen	–	–	–	(5,34)	(5,65)	(0,44)
Schlussnettoinventarwert	12,18	13,06	11,20	73,18	77,78	6,06
Gesamtertrag	6,19 %	6,87 %	6,97 %	7,57 %	8,22 %	8,22 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,24 %	0,65 %	0,58 %	1,32 %	0,71 %	1,29 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,12 %	5,35 %	5,80 %	5,48 %	6,06 %	5,36 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,46	14,25	12,20	89,36	93,83	7,53
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,56	0,68	0,59	3,89	4,72	0,31
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,55)	(2,71)	(2,32)	(14,15)	(15,00)	(1,40)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,99)	(2,03)	(1,73)	(10,26)	(10,28)	(1,09)
Ausschüttungen	–	–	–	(5,85)	(6,16)	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	11,47	12,22	10,47	73,25	77,39	6,03
Gesamtertrag	(14,78 %)	(14,25 %)	(14,18 %)	(11,77 %)	(11,23 %)	(14,81 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,27 %	0,66 %	0,59 %	1,35 %	0,74 %	1,29 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,63 %	5,56 %	5,30 %	4,93 %	5,05 %	4,66 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR A €	Ausschüttende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Ausschüttende Klasse EUR I2 €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	18,42	7,01	16,30	6,74	11,44	6,65
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	1,01	0,37	1,00	0,40	0,72	0,40
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,51	0,18	0,46	0,18	0,31	0,17
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,52	0,55	1,46	0,58	1,03	0,57
Ausschüttungen	–	(0,37)	–	(0,40)	–	(0,40)
Schlussnettoinventarwert	19,94	7,19	17,76	6,92	12,47	6,82
Gesamtertrag	8,25 %	8,25 %	8,96 %	9,01 %	9,00 %	9,00 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,28 %	1,29 %	0,70 %	0,71 %	0,61 %	0,61 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,34 %	5,35 %	5,93 %	5,94 %	6,07 %	6,06 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	21,61	8,62	19,02	8,30	13,33	8,19
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,92	0,36	0,92	0,39	0,65	0,38
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(4,11)	(1,61)	(3,64)	(1,56)	(2,54)	(1,53)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,19)	(1,25)	(2,72)	(1,17)	(1,89)	(1,15)
Ausschüttungen	–	(0,36)	–	(0,39)	–	(0,39)
Schlussnettoinventarwert	18,42	7,01	16,30	6,74	11,44	6,65
Gesamtertrag	(14,76 %)	(14,73 %)	(14,30 %)	(14,32 %)	(14,18 %)	(14,23 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,28 %	1,29 %	0,69 %	0,70 %	0,59 %	0,56 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,70 %	4,70 %	5,31 %	5,22 %	5,46 %	5,95 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse GBP A	Ausschüttende Klasse GBP A	Thesaurierende Klasse GBP I
	€	€	£	£	£	£
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,36	10,87	6,20	12,91	7,59	15,62
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,51	0,73	0,33	0,71	0,41	0,96
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,28	0,30	0,27	0,58	0,32	0,71
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,79	1,03	0,60	1,29	0,73	1,67
Ausschüttungen	–	–	(0,46)	–	(0,41)	–
Schlussnettoinventarwert	11,15	11,90	6,34	14,20	7,91	17,29
Gesamtertrag	7,63 %	9,48 %	10,12 %	9,99 %	9,98 %	10,69 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,88 %	0,12 %	1,29 %	1,29 %	1,29 %	0,70 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,77 %	6,53 %	5,34 %	5,32 %	5,34 %	5,92 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,23	12,60	7,60	14,87	9,18	17,89
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,46	0,67	0,33	0,66	0,40	0,90
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,33)	(2,40)	(1,31)	(2,62)	(1,60)	(3,17)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,87)	(1,73)	(0,98)	(1,96)	(1,20)	(2,27)
Ausschüttungen	–	–	(0,42)	–	(0,39)	–
Schlussnettoinventarwert	10,36	10,87	6,20	12,91	7,59	15,62
Gesamtertrag	(15,29 %)	(13,73 %)	(13,21 %)	(13,18 %)	(13,27 %)	(12,69 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,86 %	0,10 %	1,34 %	1,34 %	1,34 %	0,72 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,17 %	5,90 %	4,82 %	4,90 %	4,86 %	5,52 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I2	Thesaurierende Klasse GBP Z	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse SEK A
	£	£	£	£	HKD	SEK
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,21	12,49	7,27	12,06	6,53	125,59
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,49	0,79	0,44	0,82	0,35	7,44
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,34	0,56	0,30	0,54	0,25	3,00
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,83	1,35	0,74	1,36	0,60	10,44
Ausschüttungen	(0,49)	–	(0,44)	–	(0,48)	–
Schlussnettoinventarwert	8,55	13,84	7,57	13,42	6,65	136,03
Gesamtertrag	10,56 %	10,81 %	10,66 %	11,28 %	9,62 %	8,31 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,70 %	0,61 %	0,61 %	0,12 %	1,32 %	1,34 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,90 %	6,05 %	6,04 %	6,50 %	5,46 %	5,74 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,93	14,29	8,79	13,72	7,97	146,45
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,49	0,73	0,43	0,77	0,33	6,55
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,73)	(2,53)	(1,52)	(2,43)	(1,33)	(27,41)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,24)	(1,80)	(1,09)	(1,66)	(1,00)	(20,86)
Ausschüttungen	(0,48)	–	(0,43)	–	(0,44)	–
Schlussnettoinventarwert	8,21	12,49	7,27	12,06	6,53	125,59
Gesamtertrag	(12,72 %)	(12,60 %)	(12,59 %)	(12,10 %)	(12,84 %)	(14,24 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,73 %	0,62 %	0,60 %	0,11 %	1,30 %	1,34 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,42 %	5,61 %	5,92 %	6,19 %	4,79 %	4,91 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse SGD A	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A
	SGD	SGD	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,65	26,58	6,93	6,65	16,32	8,20
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,73	1,48	0,38	0,36	0,93	0,45
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,45	0,95	0,33	0,32	0,82	0,39
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,18	2,43	0,71	0,68	1,75	0,84
Ausschüttungen	(1,00)	–	(0,51)	(0,49)	–	(0,44)
Schlussnettoinventarwert	13,83	29,01	7,13	6,84	18,07	8,60
Gesamtertrag	9,09 %	9,14 %	10,74 %	10,65 %	10,72 %	10,72 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,30 %	1,30 %	1,32 %	1,32 %	1,32 %	1,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,37 %	5,37 %	5,47 %	5,47 %	5,47 %	5,47 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	16,64	30,46	8,42	8,07	18,63	9,80
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,68	1,29	0,35	0,34	0,81	0,41
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,76)	(5,17)	(1,38)	(1,32)	(3,12)	(1,61)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,08)	(3,88)	(1,03)	(0,98)	(2,31)	(1,20)
Ausschüttungen	(0,91)	–	(0,46)	(0,44)	–	(0,40)
Schlussnettoinventarwert	13,65	26,58	6,93	6,65	16,32	8,20
Gesamtertrag	(12,73 %)	(12,74 %)	(12,45 %)	(12,35 %)	(12,40 %)	(12,37 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,27 %	1,27 %	1,31 %	1,30 %	1,31 %	1,31 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,65 %	4,65 %	4,76 %	4,87 %	4,79 %	4,76 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD C	Thesaurierende Klasse USD C1	Ausschüttende Klasse USD C1	Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	5,38	10,88	12,07	9,85	8,29	5,38
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,21	0,43	0,61	0,45	0,37	0,21
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,25	0,54	0,60	0,50	0,39	0,24
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,46	0,97	1,21	0,95	0,76	0,45
Ausschüttungen	(0,39)	–	–	–	(0,36)	(0,39)
Schlussnettoinventarwert	5,45	11,85	13,28	10,80	8,69	5,44
Gesamtertrag	9,04 %	8,92 %	10,02 %	9,64 %	9,55 %	8,84 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,92 %	2,92 %	1,92 %	2,32 %	2,32 %	2,93 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,87 %	3,86 %	4,87 %	4,47 %	4,47 %	3,82 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	6,70	12,61	13,86	11,36	9,90	6,70
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,19	0,36	0,53	0,39	0,33	0,18
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,10)	(2,09)	(2,32)	(1,90)	(1,62)	(1,09)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,91)	(1,73)	(1,79)	(1,51)	(1,29)	(0,91)
Ausschüttungen	(0,41)	–	–	–	(0,32)	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	5,38	10,88	12,07	9,85	8,29	5,38
Gesamtertrag	(13,86 %)	(13,72 %)	(12,91 %)	(13,29 %)	(13,20 %)	(13,86 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,91 %	2,91 %	1,91 %	2,31 %	2,31 %	2,91 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,18 %	3,16 %	4,19 %	3,79 %	3,78 %	3,14 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C2	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD E	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,89	5,46	9,81	7,20	24,73	9,48
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,43	0,21	0,39	0,44	1,56	0,58
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,54	0,26	0,49	0,34	1,25	0,45
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,97	0,47	0,88	0,78	2,81	1,03
Ausschüttungen	–	(0,40)	–	(0,53)	–	(0,57)
Schlussnettoinventarwert	11,86	5,53	10,69	7,45	27,54	9,94
Gesamtertrag	8,91 %	9,02 %	8,97 %	11,37 %	11,36 %	11,36 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,94 %	2,92 %	2,93 %	0,72 %	0,72 %	0,72 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,86 %	3,87 %	3,85 %	6,06 %	6,06 %	6,06 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,63	6,79	11,38	8,69	28,05	11,34
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,36	0,19	0,33	0,41	1,38	0,54
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,10)	(1,10)	(1,90)	(1,42)	(4,70)	(1,87)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,74)	(0,91)	(1,57)	(1,01)	(3,32)	(1,33)
Ausschüttungen	–	(0,42)	–	(0,48)	–	(0,53)
Schlussnettoinventarwert	10,89	5,46	9,81	7,20	24,73	9,48
Gesamtertrag	(13,78 %)	(13,73 %)	(13,80 %)	(11,86 %)	(11,84 %)	(11,90 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,91 %	2,91 %	2,91 %	0,71 %	0,70 %	0,71 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,18 %	3,18 %	3,18 %	5,38 %	5,42 %	5,31 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich) US$	Thesaurierende Klasse USD I2 US$	Ausschüttende Klasse USD I2 US$	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Ausschüttende Klasse USD M US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,09	13,53	7,91	8,88	12,12	7,79
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,50	0,87	0,49	0,57	0,61	0,38
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,39	0,68	0,38	0,43	0,61	0,36
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,89	1,55	0,87	1,00	1,22	0,74
Ausschüttungen	(0,60)	–	(0,48)	(0,46)	–	(0,52)
Schlussnettoinventarwert	8,38	15,08	8,30	9,42	13,34	8,01
Gesamtertrag	11,49 %	11,46 %	11,55 %	11,63 %	10,07 %	10,05 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,62 %	0,62 %	0,62 %	0,48 %	1,92 %	1,92 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	6,17 %	6,17 %	6,19 %	6,31 %	4,87 %	4,89 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,76	15,33	9,46	10,56	13,92	9,49
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,47	0,77	0,46	0,53	0,53	0,35
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,60)	(2,57)	(1,56)	(1,75)	(2,33)	(1,55)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,13)	(1,80)	(1,10)	(1,22)	(1,80)	(1,20)
Ausschüttungen	(0,54)	–	(0,45)	(0,46)	–	(0,50)
Schlussnettoinventarwert	8,09	13,53	7,91	8,88	12,12	7,79
Gesamtertrag	(11,82 %)	(11,74 %)	(11,79 %)	(11,71 %)	(12,93 %)	(12,84 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,61 %	0,61 %	0,60 %	0,47 %	1,91 %	1,91 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,50 %	5,47 %	5,62 %	5,65 %	4,20 %	4,19 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD P	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)	Thesaurierende Klasse USD T	Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD U
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,67	5,95	5,99	12,02	6,77	13,22
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,67	0,29	0,29	0,61	0,39	0,79
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,55	0,28	0,28	0,60	0,32	0,67
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,22	0,57	0,57	1,21	0,71	1,46
Ausschüttungen	–	(0,44)	(0,44)	–	(0,50)	–
Schlussnettoinventarwert	11,89	6,08	6,12	13,23	6,98	14,68
Gesamtertrag	11,43 %	9,99 %	9,91 %	10,07 %	10,97 %	11,04 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,69 %	1,92 %	1,92 %	1,92 %	1,02 %	1,02 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	6,05 %	4,87 %	4,87 %	4,88 %	5,77 %	5,75 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,10	7,33	7,37	13,80	8,20	15,05
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,60	0,27	0,27	0,53	0,37	0,70
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,03)	(1,20)	(1,20)	(2,31)	(1,35)	(2,53)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,43)	(0,93)	(0,93)	(1,78)	(0,98)	(1,83)
Ausschüttungen	–	(0,45)	(0,45)	–	(0,45)	–
Schlussnettoinventarwert	10,67	5,95	5,99	12,02	6,77	13,22
Gesamtertrag	(11,82 %)	(12,92 %)	(12,83 %)	(12,90 %)	(12,17 %)	(12,16 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,68 %	1,91 %	1,91 %	1,91 %	1,00 %	1,01 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,37 %	4,20 %	4,19 %	4,20 %	5,11 %	5,09 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR E	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)
	US$	ZAR	ZAR	ZAR	ZAR	ZAR
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,65	53,76	53,71	53,15	148,94	59,48
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,88	2,04	2,06	2,02	5,96	2,85
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,64	3,93	3,90	3,88	11,77	4,38
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,52	5,97	5,96	5,90	17,73	7,23
Ausschüttungen	–	(5,80)	(5,79)	(5,73)	–	(6,44)
Schlussnettoinventarwert	14,17	53,93	53,88	53,32	166,67	60,27
Gesamtertrag	12,02 %	11,90 %	11,90 %	11,90 %	11,90 %	13,02 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,12 %	2,90 %	2,96 %	2,91 %	2,91 %	1,91 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	6,65 %	3,84 %	3,85 %	3,85 %	3,84 %	4,83 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	14,26	67,31	67,24	66,55	166,84	73,73
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,78	1,94	1,94	1,92	5,09	2,81
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(2,39)	(8,93)	(8,92)	(8,83)	(22,99)	(9,84)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,61)	(6,99)	(6,98)	(6,91)	(17,90)	(7,03)
Ausschüttungen	–	(6,56)	(6,55)	(6,49)	–	(7,22)
Schlussnettoinventarwert	12,65	53,76	53,71	53,15	148,94	59,48
Gesamtertrag	(11,29 %)	(10,73 %)	(10,72 %)	(10,73 %)	(10,73 %)	(9,83 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,11 %	3,02 %	3,02 %	3,02 %	3,02 %	1,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,98 %	3,26 %	3,20 %	3,23 %	3,21 %	4,33 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR
31. Dezember 2023	
Eröffnungsnettoinventarwert	137,52
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	6,98
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	10,94
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	17,92
Schlussnettoinventarwert	155,44
Gesamtertrag	13,03 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	1,90 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,83 %
31. Dezember 2022	
Eröffnungsnettoinventarwert	152,51
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	6,16
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(21,15)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(14,99)
Schlussnettoinventarwert	137,52
Gesamtertrag	(9,83 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	1,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,34 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G

	Thesaurierende Klasse CHF I4	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I4	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR X	Thesaurierende Klasse SGD A
	CHF	€	€	€	€	SGD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	6,39	6,32	6,42	7,58	6,33	12,97
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,04	(0,04)	0,04	(0,12)	(0,03)	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	1,67	1,79	1,84	2,04	1,81	3,81
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,71	1,75	1,88	1,92	1,78	3,71
Schlussnettoinventarwert	8,10	8,07	8,30	9,50	8,11	16,68
Gesamtertrag	26,76 %	27,69 %	29,28 %	25,33 %	28,12 %	28,60 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,68 %	1,88 %	0,71 %	2,66 %	1,63 %	1,88 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,50 %	(0,54 %)	0,53 %	(1,43 %)	(0,40 %)	(0,65 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,86	10,82	10,88	11,94	10,83	21,75
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,03	(0,05)	0,04	(0,13)	(0,03)	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(4,50)	(4,45)	(4,50)	(4,23)	(4,47)	(8,68)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,47)	(4,50)	(4,46)	(4,36)	(4,50)	(8,78)
Schlussnettoinventarwert	6,39	6,32	6,42	7,58	6,33	12,97
Gesamtertrag	(41,16 %)	(41,59 %)	(40,99 %)	(36,52 %)	(41,55 %)	(40,37 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,70 %	1,89 %	0,72 %	2,67 %	1,64 %	1,86 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,45 %	(0,68 %)	0,51 %	(1,46 %)	(0,43 %)	(0,65 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse SGD I4 SGD	Thesaurierende Klasse SGD X SGD	Thesaurierende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I4 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,20	13,02	6,55	6,64	6,67	6,26
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,08	(0,06)	(0,05)	0,02	0,04	(0,11)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	3,90	3,82	2,07	2,10	2,12	1,98
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,98	3,76	2,02	2,12	2,16	1,87
Schlussnettoinventarwert	17,18	16,78	8,57	8,76	8,83	8,13
Gesamtertrag	30,15 %	28,88 %	30,84 %	31,93 %	32,38 %	29,87 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,71 %	1,64 %	1,90 %	1,07 %	0,73 %	2,71 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,53 %	(0,41 %)	(0,67 %)	0,21 %	0,52 %	(1,46 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	21,88	21,78	10,90	10,95	10,97	10,51
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,08	(0,06)	(0,05)	0,03	0,04	(0,10)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(8,76)	(8,70)	(4,30)	(4,34)	(4,34)	(4,15)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(8,68)	(8,76)	(4,35)	(4,31)	(4,30)	(4,25)
Schlussnettoinventarwert	13,20	13,02	6,55	6,64	6,67	6,26
Gesamtertrag	(39,67 %)	(40,22 %)	(39,91 %)	(39,36 %)	(39,20 %)	(40,44 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,71 %	1,62 %	1,92 %	1,07 %	0,73 %	2,71 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,51 %	(0,40 %)	(0,70 %)	0,35 %	0,49 %	(1,45 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD X US$
31. Dezember 2023	
Eröffnungsnettoinventarwert	6,58
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,03)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	2,08
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,05
Schlussnettoinventarwert	8,63
Gesamtertrag	31,16 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen++	1,67 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,41 %)
31. Dezember 2022	
Eröffnungsnettoinventarwert	10,92
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,03)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(4,31)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,34)
Schlussnettoinventarwert	6,58
Gesamtertrag	(39,74 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen++	1,67 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,37 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Japanischen Aktienengagement

	Ausschüttende Klasse EUR I5	Thesaurierende Klasse GBP I5	Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse JPY I	Ausschüttende Klasse JPY I
	€	£	£	£	¥	¥
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,46	8,13	10,00	7,89	1.450,08	1.450,06
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,13	0,10	0,07	0,10	7,38	(8,31)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	2,51	2,09	0,71	0,40	285,07	298,39
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,64	2,19	0,78	0,50	292,45	290,08
Ausschüttungen	(0,12)	–	–	–	–	(10,90)
Schlussnettoinventarwert	11,98	10,32	10,78	8,39	1.742,53	1.729,24
Gesamtertrag	28,28 %	26,94 %	7,80 %	6,34 %	20,17 %	20,17 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,55 %	0,59 %	0,70 %	1,10 %	1,06 %	0,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,27 %	1,13 %	1,40 %	1,29 %	0,46 %	(0,55 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	9,34	–	9,39	1.688,22	1.688,38
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,12	0,09	–	0,06	11,01	10,33
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,66)	(1,30)	–	(1,56)	(249,15)	(248,65)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,54)	(1,21)	–	(1,50)	(238,14)	(238,32)
Schlussnettoinventarwert	9,46	8,13	–	7,89	1.450,08	1.450,06
Gesamtertrag	(5,40 %)	(12,96 %)	–	(15,97 %)	(14,18 %)	(14,18 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,56 %	0,60 %	–	1,00 %	1,02 %	1,00 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,41 %	1,12 %	–	0,78 %	0,73 %	0,69 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse JPY I5 ¥	Thesaurierende Klasse JPY Z ¥
31. Dezember 2023		
Eröffnungsnettoinventarwert	9.380,86	922,43
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	133,80	15,96
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1.805,98	179,52
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1.939,78	195,48
Schlussnettoinventarwert	11.320,64	1.117,91
Gesamtertrag	20,68 %	21,19 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	0,62 %	0,17 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,28 %	1,56 %
31. Dezember 2022		
Eröffnungsnettoinventarwert	10.883,95	1.065,69
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	130,14	19,75
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1.633,23)	(163,01)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1.503,09)	(143,26)
Schlussnettoinventarwert	9.380,86	922,43
Gesamtertrag	(13,81 %)	(13,44 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	0,60 %	0,34 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,34 %	2,06 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse GBP Z £	Thesaurierende Klasse SEK I SEK	Ausschüttende Klasse SEK I SEK	Thesaurierende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,23	9,71	93,64	96,89	9,66	9,84
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,03)	0,04	(0,20)	(0,23)	(0,03)	0,04
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,33	0,50	3,48	3,61	0,58	0,58
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,30	0,54	3,28	3,38	0,55	0,62
Ausschüttungen	–	–	–	(0,07)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,53	10,25	96,92	100,20	10,21	10,46
Gesamtertrag	3,25 %	5,56 %	3,50 %	3,49 %	5,69 %	6,30 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,82 %	0,21 %	0,79 %	0,80 %	0,84 %	0,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,27 %)	0,38 %	(0,21 %)	(0,24 %)	(0,27 %)	0,41 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,47	9,73	95,49	98,77	9,71	9,84
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,01	0,07	0,07	0,17	0,01	0,07
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,25)	(0,09)	(1,92)	(1,97)	(0,06)	(0,07)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,24)	(0,02)	(1,85)	(1,80)	(0,05)	0,00
Ausschüttungen	–	–	–	(0,08)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,23	9,71	93,64	96,89	9,66	9,84
Gesamtertrag	(2,53 %)	(0,21 %)	(1,94 %)	(1,83 %)	(0,51 %)	0,00 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,82 %	0,22 %	0,85 %	0,85 %	0,82 %	0,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,13 %	0,72 %	0,08 %	0,17 %	0,10 %	0,66 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1
	€	€	€	€	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,62	8,21	13,43	15,72	13,10	14,16
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,11)	0,00	0,00	(0,29)	(0,13)	(0,30)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	3,03	2,15	3,37	3,91	3,85	4,13
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,92	2,15	3,37	3,62	3,72	3,83
Schlussnettoinventarwert	14,54	10,36	16,80	19,34	16,82	17,99
Gesamtertrag	25,13 %	26,19 %	25,09 %	23,03 %	28,40 %	27,05 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,85 %	1,01 %	1,02 %	2,64 %	1,90 %	2,90 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,84 %)	0,01 %	0,00	(1,61 %)	(0,85 %)	(1,84 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	16,56	11,60	17,08	20,33	17,91	19,54
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,14)	(0,02)	(0,03)	(0,32)	(0,15)	(0,33)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(4,80)	(3,37)	(3,62)	(4,29)	(4,66)	(5,05)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,94)	(3,39)	(3,65)	(4,61)	(4,81)	(5,38)
Schlussnettoinventarwert	11,62	8,21	13,43	15,72	13,10	14,16
Gesamtertrag	(29,83 %)	(29,22 %)	(21,37 %)	(22,68 %)	(26,86 %)	(27,53 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,86 %	1,02 %	1,03 %	2,65 %	1,90 %	2,89 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,05 %)	(0,21 %)	(0,20 %)	(1,82 %)	(1,05 %)	(2,09 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD X US$
31. Dezember 2023				
Eröffnungsnettoinventarwert	13,25	13,24	14,25	15,48
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,00	0,00	(0,27)	(0,12)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	3,90	3,90	4,18	4,54
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	3,90	3,90	3,91	4,42
Schlussnettoinventarwert	17,15	17,14	18,16	19,90
Gesamtertrag	29,43 %	29,46 %	27,44 %	28,55 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	1,05 %	1,05 %	2,70 %	1,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,02 %	0,00	(1,64 %)	(0,70 %)
31. Dezember 2022				
Eröffnungsnettoinventarwert	17,96	17,94	19,64	21,13
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,04)	(0,03)	(0,29)	(0,15)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(4,67)	(4,67)	(5,10)	(5,50)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,71)	(4,70)	(5,39)	(5,65)
Schlussnettoinventarwert	13,25	13,24	14,25	15,48
Gesamtertrag	(26,22 %)	(26,20 %)	(27,44 %)	(26,74 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	1,04 %	1,05 %	2,69 %	1,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,25 %)	(0,21 %)	(1,85 %)	(0,90 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Space Economy[2]

	Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD I
	€	€	US$
31. Dezember 2023			
Eröffnungsnettoinventarwert	9,51	9,39	9,61
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,03	(0,16)	0,01
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	2,18	2,13	2,61
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,21	1,97	2,62
Schlussnettoinventarwert	11,72	11,36	12,23
Gesamtertrag	23,24 %	20,98 %	27,26 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen[++]	0,79 %	2,66 %	1,06 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,32 %	(1,53 %)	0,06 %
31. Dezember 2022			
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,05	(0,08)	0,02
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,54)	(0,53)	(0,41)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,49)	(0,61)	(0,39)
Schlussnettoinventarwert	9,51	9,39	9,61
Gesamtertrag	(4,90 %)	(6,10 %)	(3,90 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen[++]	0,68 %	2,50 %	0,96 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,86 %	(1,15 %)	0,43 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency

	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich) US$	Thesaurierende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD C1 US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich) US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,83	10,99	8,68	11,47	8,96	10,12
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,24	0,35	0,19	0,44	0,42	0,40
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,20	0,29	0,22	0,30	0,14	0,25
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,44	0,64	0,41	0,74	0,56	0,65
Ausschüttungen	(0,49)	–	–	–	(0,31)	(0,63)
Schlussnettoinventarwert	7,78	11,63	9,09	12,21	9,21	10,14
Gesamtertrag	5,82 %	5,82 %	4,72 %	6,45 %	6,46 %	6,70 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,36 %	1,36 %	2,36 %	0,76 %	1,05 %	0,52 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,12 %	3,12 %	2,10 %	3,72 %	4,80 %	3,96 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,54	12,77	10,19	13,26	10,70	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,24	0,32	0,17	0,41	0,31	0,10
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,56)	(2,10)	(1,68)	(2,20)	(1,70)	0,13
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,32)	(1,78)	(1,51)	(1,79)	(1,39)	0,23
Ausschüttungen	(0,39)	–	–	–	(0,35)	(0,11)
Schlussnettoinventarwert	7,83	10,99	8,68	11,47	8,96	10,12
Gesamtertrag	(13,91 %)	(13,94 %)	(14,82 %)	(13,50 %)	(13,41 %)	2,30 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,39 %	1,39 %	2,39 %	0,79 %	0,78 %	0,52 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,86 %	2,84 %	1,83 %	3,45 %	3,47 %	3,69 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I4	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD X	Thesaurierende Klasse USD Z
	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023					
Eröffnungsnettoinventarwert	10,23	8,86	10,10	8,54	10,01
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,42	0,22	0,32	0,28	0,45
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,27	0,24	0,26	0,23	0,26
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,69	0,46	0,58	0,51	0,71
Ausschüttungen	–	–	(0,63)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,92	9,32	10,05	9,05	10,72
Gesamtertrag	6,74 %	5,19 %	5,97 %	5,97 %	7,09 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen++	0,51 %	1,97 %	1,26 %	1,26 %	0,16 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,97 %	2,48 %	3,22 %	3,22 %	4,38 %
31. Dezember 2022					
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,36	10,00	9,87	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,10	0,21	0,08	0,28	0,02
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,13	(1,71)	0,13	(1,61)	(0,01)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,23	(1,50)	0,21	(1,33)	0,01
Ausschüttungen	–	–	(0,11)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,23	8,86	10,10	8,54	10,01
Gesamtertrag	2,30 %	(14,48 %)	2,10 %	(13,48 %)	0,10 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen++	0,52 %	1,99 %	1,25 %	1,00 %	0,16 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,69 %	2,25 %	2,96 %	3,24 %	3,69 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich) CAD	Thesaurierende Klasse CHF A CHF	Ausschüttende Klasse CHF A CHF	Thesaurierende Klasse CHF I CHF	Ausschüttende Klasse CHF I CHF
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,91	8,21	9,23	6,80	9,64	6,82
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,24	0,25	0,27	0,20	0,33	0,23
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,22	0,29	0,04	0,02	0,04	0,02
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,46	0,54	0,31	0,22	0,37	0,25
Ausschüttungen	(0,50)	(0,52)	–	(0,22)	–	(0,25)
Schlussnettoinventarwert	7,87	8,23	9,54	6,80	10,01	6,82
Gesamtertrag	6,06 %	6,84 %	3,36 %	3,32 %	3,84 %	3,84 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,06 %	1,06 %	1,02 %	1,02 %	0,55 %	0,55 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,05 %	3,11 %	2,93 %	2,94 %	3,35 %	3,41 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,04	9,33	10,23	7,79	10,63	7,82
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,27	0,28	0,30	0,22	0,35	0,25
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,01)	(1,00)	(1,30)	(0,97)	(1,34)	(0,97)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,74)	(0,72)	(1,00)	(0,75)	(0,99)	(0,72)
Ausschüttungen	(0,39)	(0,40)	–	(0,24)	–	(0,28)
Schlussnettoinventarwert	7,91	8,21	9,23	6,80	9,64	6,82
Gesamtertrag	(8,23 %)	(7,71 %)	(9,78 %)	(9,73 %)	(9,31 %)	(9,35 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,10 %	1,12 %	1,05 %	1,05 %	0,56 %	0,56 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,29 %	3,35 %	3,11 %	3,11 %	3,59 %	3,58 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse CHF I2 CHF	Ausschüttende Klasse CHF I2 CHF	Thesaurierende Klasse CHF I5 CHF	Thesaurierende Klasse CHF P CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Ausschüttende Klasse EUR A €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,84	7,49	10,02	9,32	9,55	7,04
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,35	0,26	0,37	0,32	0,30	0,21
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,04	0,02	0,05	0,04	0,21	0,16
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,39	0,28	0,42	0,36	0,51	0,37
Ausschüttungen	–	(0,28)	–	–	–	(0,23)
Schlussnettoinventarwert	10,23	7,49	10,44	9,68	10,06	7,18
Gesamtertrag	3,96 %	3,94 %	4,19 %	3,86 %	5,34 %	5,35 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,46 %	0,44 %	0,32 %	0,53 %	1,07 %	1,07 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,48 %	3,44 %	3,64 %	3,41 %	3,07 %	3,07 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,84	8,58	11,03	10,27	10,55	8,05
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,36	0,29	0,40	0,35	0,31	0,23
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,36)	(1,07)	(1,41)	(1,30)	(1,31)	(0,99)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,00)	(0,78)	(1,01)	(0,95)	(1,00)	(0,76)
Ausschüttungen	–	(0,31)	–	–	–	(0,25)
Schlussnettoinventarwert	9,84	7,49	10,02	9,32	9,55	7,04
Gesamtertrag	(9,23 %)	(9,17 %)	(9,16 %)	(9,25 %)	(9,48 %)	(9,51 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,47 %	0,47 %	0,32 %	0,54 %	1,06 %	1,06 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,71 %	3,69 %	3,83 %	3,62 %	3,16 %	3,16 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Ausschüttende Klasse EUR I2 €	Thesaurierende Klasse EUR I5 €	Thesaurierende Klasse EUR M €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,98	7,05	10,06	7,63	10,43	9,33
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,36	0,25	0,37	0,28	0,40	0,23
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,22	0,14	0,22	0,15	0,24	0,20
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,58	0,39	0,59	0,43	0,64	0,43
Ausschüttungen	–	(0,26)	–	(0,29)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,56	7,18	10,65	7,77	11,07	9,76
Gesamtertrag	5,81 %	5,72 %	5,86 %	5,82 %	6,14 %	4,61 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,58 %	0,58 %	0,48 %	0,48 %	0,33 %	1,66 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,56 %	3,56 %	3,66 %	3,66 %	3,81 %	2,48 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,97	8,05	11,05	8,72	11,44	10,36
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,38	0,27	0,38	0,28	0,42	0,25
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,37)	(0,98)	(1,37)	(1,05)	(1,43)	(1,28)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,99)	(0,71)	(0,99)	(0,77)	(1,01)	(1,03)
Ausschüttungen	–	(0,29)	–	(0,32)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,98	7,05	10,06	7,63	10,43	9,33
Gesamtertrag	(9,02 %)	(8,91 %)	(8,96 %)	(8,89 %)	(8,83 %)	(9,94 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,57 %	0,57 %	0,47 %	0,47 %	0,33 %	1,65 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,66 %	3,66 %	3,74 %	3,74 %	3,92 %	2,57 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR P €	Thesaurierende Klasse EUR U €	Ausschüttende Klasse EUR X €	Thesaurierende Klasse GBP A £	Thesaurierende Klasse GBP I £
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	6,79	9,56	9,49	8,80	10,00	10,30
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,17	0,34	0,32	0,32	0,31	0,37
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,13	0,22	0,20	0,18	0,38	0,39
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,30	0,56	0,52	0,50	0,69	0,76
Ausschüttungen	(0,29)	–	–	(0,33)	–	–
Schlussnettoinventarwert	6,80	10,12	10,01	8,97	10,69	11,06
Gesamtertrag	4,56 %	5,86 %	5,48 %	5,92 %	6,90 %	7,38 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,65 %	0,55 %	0,82 %	0,48 %	1,06 %	0,57 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,49 %	3,54 %	3,35 %	3,66 %	3,04 %	3,52 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,89	10,51	10,45	10,06	10,87	11,14
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,18	0,36	0,33	0,34	0,34	0,40
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,95)	(1,31)	(1,29)	(1,23)	(1,21)	(1,24)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,77)	(0,95)	(0,96)	(0,89)	(0,87)	(0,84)
Ausschüttungen	(0,33)	–	–	(0,37)	–	–
Schlussnettoinventarwert	6,79	9,56	9,49	8,80	10,00	10,30
Gesamtertrag	(9,94 %)	(9,04 %)	(9,19 %)	(8,92 %)	(8,00 %)	(7,54 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,65 %	0,55 %	0,82 %	0,47 %	1,11 %	0,59 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,57 %	3,68 %	3,41 %	3,75 %	3,29 %	3,81 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I5 £	Thesaurierende Klasse GBP P £	Thesaurierende Klasse JPY I ¥
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,30	10,29	8,15	7,66	9,67	1.024,16
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,29	0,38	0,30	0,29	0,35	37,46
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,31	0,39	0,29	0,27	0,37	(16,00)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,60	0,77	0,59	0,56	0,72	21,46
Ausschüttungen	(0,31)	–	(0,31)	(0,30)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,59	11,06	8,43	7,92	10,39	1.045,62
Gesamtertrag	7,43 %	7,48 %	7,47 %	7,59 %	7,45 %	2,10 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,57 %	0,47 %	0,47 %	0,33 %	0,56 %	0,59 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,52 %	3,63 %	3,69 %	3,79 %	3,57 %	3,66 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,34	11,12	9,17	8,62	10,45	1.126,55
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,33	0,41	0,33	0,32	0,37	39,33
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,03)	(1,24)	(1,01)	(0,95)	(1,15)	(141,72)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,70)	(0,83)	(0,68)	(0,63)	(0,78)	(102,39)
Ausschüttungen	(0,34)	–	(0,34)	(0,33)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,30	10,29	8,15	7,66	9,67	1.024,16
Gesamtertrag	(7,54 %)	(7,46 %)	(7,43 %)	(7,29 %)	(7,46 %)	(9,09 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,59 %	0,49 %	0,49 %	0,34 %	0,57 %	0,58 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,81 %	3,92 %	3,90 %	4,05 %	3,80 %	3,72 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse SEK A	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A
	¥	SEK	SGD	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	719,95	93,27	16,13	8,19	11,29	8,11
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	25,73	2,82	0,49	0,25	0,36	0,26
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(11,28)	2,26	0,43	0,33	0,49	0,33
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	14,45	5,08	0,92	0,58	0,85	0,59
Ausschüttungen	(26,74)	–	(1,01)	(0,51)	–	(0,26)
Schlussnettoinventarwert	707,66	98,35	16,04	8,26	12,14	8,44
Gesamtertrag	2,10 %	5,45 %	5,98 %	7,45 %	7,53 %	7,51 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,59 %	1,04 %	1,07 %	1,09 %	1,09 %	1,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,66 %	2,98 %	3,08 %	3,14 %	3,13 %	3,14 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	824,34	102,60	18,32	9,29	12,21	9,07
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	28,93	3,21	0,52	0,27	0,37	0,27
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(103,03)	(12,54)	(1,92)	(0,97)	(1,29)	(0,95)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(74,10)	(9,33)	(1,40)	(0,70)	(0,92)	(0,68)
Ausschüttungen	(30,29)	–	(0,79)	(0,40)	–	(0,28)
Schlussnettoinventarwert	719,95	93,27	16,13	8,19	11,29	8,11
Gesamtertrag	(9,09 %)	(9,09 %)	(7,66 %)	(7,54 %)	(7,53 %)	(7,55 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,58 %	1,11 %	1,05 %	1,08 %	1,08 %	1,08 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,70 %	3,31 %	3,12 %	3,22 %	3,22 %	3,21 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1 US$	Ausschüttende Klasse USD C1 US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I2 US$	Ausschüttende Klasse USD I2 US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,72	8,57	11,79	8,62	11,58	8,61
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,21	0,18	0,44	0,32	0,44	0,33
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,42	0,36	0,51	0,35	0,50	0,35
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,63	0,54	0,95	0,67	0,94	0,68
Ausschüttungen	–	(0,19)	–	(0,32)	–	(0,33)
Schlussnettoinventarwert	10,35	8,92	12,74	8,97	12,52	8,96
Gesamtertrag	6,48 %	6,46 %	8,06 %	8,04 %	8,12 %	8,15 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	2,09 %	2,09 %	0,59 %	0,59 %	0,49 %	0,49 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,13 %	2,13 %	3,63 %	3,64 %	3,68 %	3,78 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,62	9,58	12,69	9,64	12,45	9,63
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,22	0,19	0,44	0,33	0,44	0,34
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,12)	(1,00)	(1,34)	(1,01)	(1,31)	(1,01)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,90)	(0,81)	(0,90)	(0,68)	(0,87)	(0,67)
Ausschüttungen	–	(0,20)	–	(0,34)	–	(0,35)
Schlussnettoinventarwert	9,72	8,57	11,79	8,62	11,58	8,61
Gesamtertrag	(8,47 %)	(8,45 %)	(7,09 %)	(7,07 %)	(6,99 %)	(6,99 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	2,08 %	2,08 %	0,58 %	0,58 %	0,48 %	0,48 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,22 %	2,21 %	3,72 %	3,72 %	3,82 %	3,81 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I5 US$	Ausschüttende Klasse USD I5 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Ausschüttende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD P US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,98	8,25	9,94	7,84	11,42	12,18
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,48	0,32	0,26	0,20	0,43	0,52
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,52	0,34	0,42	0,32	0,49	0,52
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,00	0,66	0,68	0,52	0,92	1,04
Ausschüttungen	–	(0,33)	–	(0,34)	–	–
Schlussnettoinventarwert	12,98	8,58	10,62	8,02	12,34	13,22
Gesamtertrag	8,35 %	8,25 %	6,84 %	6,84 %	8,06 %	8,54 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,34 %	0,34 %	1,69 %	1,69 %	0,56 %	0,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,89 %	3,89 %	2,54 %	2,53 %	3,66 %	4,14 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,86	9,23	10,82	8,92	12,29	13,04
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,48	0,33	0,26	0,21	0,43	0,52
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,36)	(0,96)	(1,14)	(0,93)	(1,30)	(1,38)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,88)	(0,63)	(0,88)	(0,72)	(0,87)	(0,86)
Ausschüttungen	–	(0,35)	–	(0,36)	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,98	8,25	9,94	7,84	11,42	12,18
Gesamtertrag	(6,84 %)	(6,87 %)	(8,13 %)	(8,11 %)	(7,08 %)	(6,60 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,33 %	0,33 %	1,68 %	1,68 %	0,56 %	0,08 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,97 %	3,96 %	2,61 %	2,61 %	3,74 %	4,23 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse CHF A	Thesaurierende Klasse CHF I	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse EUR A	Ausschüttende Klasse EUR A
	AUD	CHF	CHF	CNY	€	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,08	10,75	11,64	84,25	11,29	6,76
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,34	0,51	0,62	4,16	0,57	0,33
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,18	0,01	0,02	0,83	0,21	0,13
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,52	0,52	0,64	4,99	0,78	0,46
Ausschüttungen	(0,50)	–	–	(5,85)	–	(0,33)
Schlussnettoinventarwert	7,10	11,27	12,28	83,39	12,07	6,89
Gesamtertrag	7,63 %	4,84 %	5,50 %	6,21 %	6,91 %	6,99 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,30 %	1,24 %	0,69 %	1,34 %	1,31 %	1,31 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,86 %	4,65 %	5,24 %	5,02 %	4,90 %	4,88 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,96	11,58	12,47	94,05	12,13	7,61
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,34	0,49	0,60	4,15	0,52	0,32
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,80)	(1,32)	(1,43)	(7,92)	(1,36)	(0,85)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,46)	(0,83)	(0,83)	(3,77)	(0,84)	(0,53)
Ausschüttungen	(0,42)	–	–	(6,03)	–	(0,32)
Schlussnettoinventarwert	7,08	10,75	11,64	84,25	11,29	6,76
Gesamtertrag	(5,86 %)	(7,17 %)	(6,66 %)	(4,07 %)	(6,92 %)	(7,02 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,34 %	1,27 %	0,69 %	1,36 %	1,30 %	1,30 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,71 %	4,45 %	5,03 %	4,73 %	4,51 %	4,52 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Ausschüttende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse GBP I £	Ausschüttende Klasse GBP I £
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,03	11,15	10,01	6,83	13,18	7,53
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,68	0,65	0,44	0,29	0,72	0,42
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,23	0,21	0,19	0,13	0,50	0,26
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,91	0,86	0,63	0,42	1,22	0,68
Ausschüttungen	–	–	–	(0,42)	–	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	12,94	12,01	10,64	6,83	14,40	7,80
Gesamtertrag	7,56 %	7,71 %	6,29 %	6,39 %	9,26 %	9,38 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,72 %	0,62 %	1,89 %	1,89 %	0,70 %	0,73 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,49 %	5,62 %	4,30 %	4,30 %	5,34 %	5,54 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,85	11,90	10,82	7,85	13,86	8,37
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,63	0,62	0,41	0,28	0,71	0,43
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,45)	(1,37)	(1,22)	(0,86)	(1,39)	(0,85)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,82)	(0,75)	(0,81)	(0,58)	(0,68)	(0,42)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,44)	–	(0,42)
Schlussnettoinventarwert	12,03	11,15	10,01	6,83	13,18	7,53
Gesamtertrag	(6,38 %)	(6,30 %)	(7,49 %)	(7,54 %)	(4,91 %)	(5,06 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,71 %	0,61 %	1,89 %	1,89 %	0,73 %	0,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,10 %	5,27 %	3,92 %	3,93 %	5,31 %	5,25 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse GBP I2	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse JPY I	Ausschüttende Klasse JPY I	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)
	£	£	HKD	¥	¥	SGD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,24	7,34	9,97	1.205,68	1.014,69	14,86
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,71	0,41	0,49	68,62	56,03	0,73
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,43	0,26	0,30	(23,35)	(19,43)	0,37
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,14	0,67	0,79	45,27	36,60	1,10
Ausschüttungen	–	(0,41)	(0,70)	–	(52,62)	(1,04)
Schlussnettoinventarwert	13,38	7,60	10,06	1.250,95	998,67	14,92
Gesamtertrag	9,31 %	9,44 %	8,25 %	3,75 %	3,78 %	7,74 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,62 %	0,62 %	1,33 %	0,74 %	0,74 %	1,31 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,56 %	5,54 %	4,97 %	5,62 %	5,63 %	4,93 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,86	8,15	10,00	1.288,30	1.000,00	16,57
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,67	0,42	0,13	64,55	10,05	0,69
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,29)	(0,82)	(0,04)	(147,17)	4,64	(1,52)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,62)	(0,40)	0,09	(82,62)	14,69	(0,83)
Ausschüttungen	–	(0,41)	(0,12)	–	–	(0,88)
Schlussnettoinventarwert	12,24	7,34	9,97	1.205,68	1.014,69	14,86
Gesamtertrag	(4,82 %)	(4,88 %)	0,93 %	(6,41 %)	1,47 %	(5,08 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,63 %	0,63 %	1,29 %	0,72 %	0,66 %	1,28 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,41 %	5,36 %	4,66 %	5,20 %	4,93 %	4,49 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	7,57	13,11	7,91	10,26	14,00	8,09
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,38	0,68	0,40	0,42	0,82	0,46
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,29	0,54	0,31	0,42	0,57	0,31
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,67	1,22	0,71	0,84	1,39	0,77
Ausschüttungen	(0,53)	–	(0,39)	–	–	(0,44)
Schlussnettoinventarwert	7,71	14,33	8,23	11,10	15,39	8,42
Gesamtertrag	9,25 %	9,31 %	9,25 %	8,19 %	9,93 %	9,94 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,33 %	1,33 %	1,33 %	2,33 %	0,73 %	0,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,00 %	4,99 %	4,99 %	3,98 %	5,59 %	5,65 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,41	13,77	8,70	10,89	14,61	8,87
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,36	0,61	0,37	0,37	0,73	0,43
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,75)	(1,27)	(0,79)	(1,00)	(1,34)	(0,80)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,39)	(0,66)	(0,42)	(0,63)	(0,61)	(0,37)
Ausschüttungen	(0,45)	–	(0,37)	–	–	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	7,57	13,11	7,91	10,26	14,00	8,09
Gesamtertrag	(4,73 %)	(4,79 %)	(4,83 %)	(5,79 %)	(4,18 %)	(4,15 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,32 %	1,32 %	1,32 %	2,32 %	0,71 %	0,72 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,58 %	4,59 %	4,60 %	3,60 %	5,20 %	5,08 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I2 US$	Ausschüttende Klasse USD I2 US$	Thesaurierende Klasse USD I4* US$	Thesaurierende Klasse USD I5 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Ausschüttende Klasse USD M US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,11	7,90	10,00	10,04	10,55	8,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,75	0,45	0,39	0,62	0,47	0,35
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,58	0,31	0,27	0,41	0,44	0,31
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,33	0,76	0,66	1,03	0,91	0,66
Ausschüttungen	–	(0,44)	–	–	–	(0,49)
Schlussnettoinventarwert	14,44	8,22	10,66	11,07	11,46	8,17
Gesamtertrag	10,14 %	10,02 %	6,60 %	10,26 %	8,63 %	8,68 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,62 %	0,62 %	0,51 %	0,43 %	1,93 %	1,93 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,57 %	5,63 %	5,95 %	5,90 %	4,34 %	4,35 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,68	8,69	–	10,00	11,15	8,97
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,70	0,43	–	0,17	0,43	0,34
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,27)	(0,79)	–	(0,13)	(1,03)	(0,82)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,57)	(0,36)	–	0,04	(0,60)	(0,48)
Ausschüttungen	–	(0,43)	–	–	–	(0,49)
Schlussnettoinventarwert	13,11	7,90	–	10,04	10,55	8,00
Gesamtertrag	(4,17 %)	(4,15 %)	–	0,40 %	(5,38 %)	(5,37 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,62 %	0,62 %	–	0,40 %	1,91 %	1,91 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,30 %	5,30 %	–	5,60 %	4,02 %	4,03 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023	
Eröffnungsnettoinventarwert	12,64
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,81
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,53
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,34
Schlussnettoinventarwert	13,98
Gesamtertrag	10,60 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,13 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	6,17 %
31. Dezember 2022	
Eröffnungsnettoinventarwert	13,12
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,74
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,22)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,48)
Schlussnettoinventarwert	12,64
Gesamtertrag	(3,66 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,12 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,80 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)* CNY	Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich) €	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,10	8,74	100,00	7,56	10,05	10,68
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,24	0,34	1,69	0,22	0,31	0,38
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,26	0,29	2,12	0,21	0,28	0,31
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,50	0,63	3,81	0,43	0,59	0,69
Ausschüttungen	(0,53)	(0,57)	(3,75)	(0,49)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,07	8,80	100,06	7,50	10,64	11,37
Gesamtertrag	6,42 %	7,55 %	4,01 %	5,95 %	5,87 %	6,46 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,08 %	0,12 %	1,15 %	1,10 %	1,10 %	0,61 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,00 %	3,96 %	2,98 %	3,04 %	3,03 %	3,52 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,56	10,22	–	9,04	10,00	12,18
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,22	0,34	–	0,20	0,04	0,34
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,31)	(1,43)	–	(1,33)	0,01	(1,84)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,09)	(1,09)	–	(1,13)	0,05	(1,50)
Ausschüttungen	(0,37)	(0,39)	–	(0,35)	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,10	8,74	–	7,56	10,05	10,68
Gesamtertrag	(11,58 %)	(10,76 %)	–	(12,73 %)	0,50 %	(12,32 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,15 %	0,13 %	–	1,10 %	1,16 %	0,61 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,56 %	3,79 %	–	2,46 %	2,93 %	3,01 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)*	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)
	€	£	£	HKD	¥	¥
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,85	7,95	10,00	8,31	1.065,57	1.656,82
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,24	0,24	0,02	0,25	38,46	65,42
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,28	0,34	0,21	0,33	(11,97)	204,70
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,52	0,58	0,23	0,58	26,49	270,12
Ausschüttungen	–	(0,52)	–	(0,54)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,37	8,01	10,23	8,35	1.092,06	1.926,94
Gesamtertrag	5,28 %	7,61 %	2,30 %	7,28 %	2,49 %	16,30 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,68 %	1,10 %	0,67 %	1,12 %	0,62 %	0,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,40 %	3,07 %	3,14 %	3,12 %	3,60 %	3,59 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,36	9,36	–	9,76	1.216,93	1.610,18
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,19	0,22	–	0,22	33,92	52,06
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,70)	(1,27)	–	(1,29)	(185,28)	(5,42)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,51)	(1,05)	–	(1,07)	(151,36)	46,64
Ausschüttungen	–	(0,36)	–	(0,38)	–	–
Schlussnettoinventarwert	9,85	7,95	–	8,31	1.065,57	1.656,82
Gesamtertrag	(13,29 %)	(11,37 %)	–	(11,15 %)	(12,44 %)	2,90 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,69 %	1,15 %	–	1,12 %	0,62 %	0,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,84 %	2,53 %	–	2,44 %	2,98 %	3,06 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse JPY I CG	Ausschüttende Klasse JPY I	Thesaurierende Klasse JPY Z	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse SGD A	Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)
	¥	¥	¥	SGD	SGD	SGD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	875,62	803,30	915,43	15,90	20,36	17,69
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	31,29	29,82	37,50	0,47	0,63	0,61
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(9,53)	(9,88)	(10,05)	0,56	0,74	0,62
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	21,76	19,94	27,45	1,03	1,37	1,23
Ausschüttungen	–	(24,35)	–	(1,03)	–	(1,15)
Schlussnettoinventarwert	897,38	798,89	942,88	15,90	21,73	17,77
Gesamtertrag	2,49 %	2,56 %	3,00 %	6,79 %	6,73 %	7,27 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,62 %	0,65 %	0,12 %	1,11 %	1,11 %	0,61 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,56 %	3,68 %	4,06 %	3,02 %	3,02 %	3,51 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	1.001,03	944,76	1.000,00	18,64	22,86	20,62
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	28,06	26,03	25,82	0,41	0,51	0,56
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(152,44)	(142,34)	(110,39)	(2,43)	(3,01)	(2,69)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(124,38)	(116,31)	(84,57)	(2,02)	(2,50)	(2,13)
Ausschüttungen	(1,03)	(25,15)	–	(0,72)	–	(0,80)
Schlussnettoinventarwert	875,62	803,30	915,43	15,90	20,36	17,69
Gesamtertrag	(12,44 %)	(12,44 %)	(8,46 %)	(10,99 %)	(10,94 %)	(10,48 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,62 %	0,62 %	0,12 %	1,09 %	1,09 %	0,61 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,03 %	3,02 %	3,63 %	2,44 %	2,40 %	3,03 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,11	11,37	9,39	9,99	12,27	9,43
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,25	0,36	0,29	0,21	0,45	0,34
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,40	0,58	0,47	0,51	0,64	0,48
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,65	0,94	0,76	0,72	1,09	0,82
Ausschüttungen	(0,53)	–	(0,27)	–	–	(0,32)
Schlussnettoinventarwert	8,23	12,31	9,88	10,71	13,36	9,93
Gesamtertrag	8,34 %	8,27 %	8,24 %	7,21 %	8,88 %	8,87 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,12 %	1,12 %	1,12 %	2,12 %	0,62 %	0,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,09 %	3,08 %	3,09 %	2,07 %	3,58 %	3,59 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,47	12,72	10,75	11,29	13,67	10,80
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,22	0,30	0,25	0,16	0,39	0,30
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,22)	(1,65)	(1,38)	(1,46)	(1,79)	(1,39)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,00)	(1,35)	(1,13)	(1,30)	(1,40)	(1,09)
Ausschüttungen	(0,36)	–	(0,23)	–	–	(0,28)
Schlussnettoinventarwert	8,11	11,37	9,39	9,99	12,27	9,43
Gesamtertrag	(10,63 %)	(10,61 %)	(10,62 %)	(11,51 %)	(10,24 %)	(10,19 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,12 %	1,12 %	1,12 %	2,12 %	0,62 %	0,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,51 %	2,56 %	2,56 %	1,49 %	3,05 %	3,07 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD M US$	Ausschüttende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023			
Eröffnungsnettoinventarwert	11,36	8,30	12,39
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,29	0,21	0,52
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,58	0,40	0,64
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,87	0,61	1,16
Ausschüttungen	–	(0,37)	–
Schlussnettoinventarwert	12,23	8,54	13,55
Gesamtertrag	7,66 %	7,64 %	9,36 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	1,72 %	1,72 %	0,12 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,48 %	2,48 %	4,07 %
31. Dezember 2022			
Eröffnungsnettoinventarwert	12,79	9,69	13,72
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,23	0,17	0,45
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,66)	(1,24)	(1,78)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,43)	(1,07)	(1,33)
Ausschüttungen	–	(0,32)	–
Schlussnettoinventarwert	11,36	8,30	12,39
Gesamtertrag	(11,18 %)	(11,16 %)	(9,69 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen++	1,72 %	1,72 %	0,12 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,95 %	1,96 %	3,55 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield

	Thesaurierende Klasse EUR X	Thesaurierende Klasse GBP X	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD Z
	€	£	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,51	9,31	7,63	8,28	8,34	8,70
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,46	0,48	0,27	0,34	0,39	0,46
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,45)	(0,32)	(0,17)	(0,22)	(0,22)	(0,23)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,01	0,16	0,10	0,12	0,17	0,23
Ausschüttungen	–	–	(0,66)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,52	9,47	7,07	8,40	8,51	8,93
Gesamtertrag	0,12 %	1,72 %	1,47 %	1,45 %	2,04 %	2,64 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,56 %	0,57 %	1,42 %	1,41 %	0,82 %	0,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,34 %	5,15 %	3,75 %	4,09 %	4,68 %	5,28 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	9,90	9,90	9,90	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,38	0,32	0,33	0,34	0,40	0,41
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,87)	(1,01)	(1,99)	(1,96)	(1,96)	(1,71)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,49)	(0,69)	(1,66)	(1,62)	(1,56)	(1,30)
Ausschüttungen	–	–	(0,61)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	8,51	9,31	7,63	8,28	8,34	8,70
Gesamtertrag	(14,90 %)	(6,90 %)	(16,64 %)	(16,36 %)	(15,76 %)	(13,43 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,54 %	0,54 %	1,40 %	1,40 %	0,80 %	0,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,41 %	5,16 %	4,17 %	4,18 %	4,82 %	4,93 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023	
Eröffnungsnettoinventarwert	9,42
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,48
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,25)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,23
Ausschüttungen	(0,52)
Schlussnettoinventarwert	9,13
Gesamtertrag	2,56 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,22 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,29 %
31. Dezember 2022	
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,39
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,70)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,31)
Ausschüttungen	(0,27)
Schlussnettoinventarwert	9,42
Gesamtertrag	(2,84 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen[++]	0,19 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	5,54 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

	Thesaurierende Klasse CHF I CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Ausschüttende Klasse EUR M €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,96	9,94	11,42	9,75	9,51	6,66
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,44	0,34	0,48	0,44	0,25	0,17
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,03)	0,13	0,17	0,14	0,12	0,07
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,41	0,47	0,65	0,58	0,37	0,24
Ausschüttungen	–	–	–	–	–	(0,34)
Schlussnettoinventarwert	11,37	10,41	12,07	10,33	9,88	6,56
Gesamtertrag	3,74 %	4,73 %	5,69 %	5,95 %	3,89 %	3,81 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,95 %	1,78 %	0,99 %	0,68 %	2,56 %	2,56 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	3,95 %	3,36 %	4,14 %	4,44 %	2,57 %	2,57 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,78	11,64	13,27	11,29	11,23	8,30
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,47	0,36	0,49	0,45	0,26	0,18
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,29)	(2,06)	(2,34)	(1,99)	(1,98)	(1,43)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,82)	(1,70)	(1,85)	(1,54)	(1,72)	(1,25)
Ausschüttungen	–	–	–	–	–	(0,39)
Schlussnettoinventarwert	10,96	9,94	11,42	9,75	9,51	6,66
Gesamtertrag	(14,24 %)	(14,60 %)	(13,94 %)	(13,64 %)	(15,32 %)	(15,23 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,99 %	1,79 %	1,00 %	0,69 %	2,58 %	2,58 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,05 %	3,18 %	4,14 %	4,44 %	2,56 %	2,56 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR X	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse SEK A	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD C1
	€	£	SEK	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,36	12,35	87,48	7,32	12,24	9,32
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,48	0,52	2,88	0,25	0,43	0,23
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,15	0,38	1,46	0,24	0,43	0,33
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,63	0,90	4,34	0,49	0,86	0,56
Ausschüttungen	–	–	–	(0,41)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,99	13,25	91,82	7,40	13,10	9,88
Gesamtertrag	6,08 %	7,29 %	4,96 %	6,95 %	7,03 %	6,01 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,58 %	0,99 %	1,73 %	1,81 %	1,81 %	2,82 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,54 %	4,11 %	3,26 %	3,42 %	3,42 %	2,42 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,99	14,13	102,06	8,81	14,03	10,80
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,49	0,57	3,21	0,27	0,43	0,23
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,12)	(2,35)	(17,79)	(1,37)	(2,22)	(1,71)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,63)	(1,78)	(14,58)	(1,10)	(1,79)	(1,48)
Ausschüttungen	–	–	–	(0,39)	–	–
Schlussnettoinventarwert	10,36	12,35	87,48	7,32	12,24	9,32
Gesamtertrag	(13,59 %)	(12,60 %)	(14,29 %)	(12,64 %)	(12,76 %)	(13,70 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,59 %	1,04 %	1,87 %	1,82 %	1,82 %	2,82 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,55 %	4,14 %	3,49 %	3,31 %	3,41 %	2,38 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I2 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Ausschüttende Klasse USD M US$
31. Dezember 2023					
Eröffnungsnettoinventarwert	13,20	8,77	11,93	9,38	7,19
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,57	0,37	0,53	0,25	0,19
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,47	0,30	0,43	0,32	0,23
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,04	0,67	0,96	0,57	0,42
Ausschüttungen	–	(0,37)	–	–	(0,37)
Schlussnettoinventarwert	14,24	9,07	12,89	9,95	7,24
Gesamtertrag	7,88 %	7,90 %	8,05 %	6,08 %	6,16 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen[++]	1,01 %	1,02 %	0,85 %	2,60 %	2,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,23 %	4,23 %	4,37 %	2,60 %	2,62 %
31. Dezember 2022					
Eröffnungsnettoinventarwert	15,01	10,41	13,54	10,83	8,76
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,57	0,38	0,53	0,25	0,20
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(2,38)	(1,63)	(2,14)	(1,70)	(1,36)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,81)	(1,25)	(1,61)	(1,45)	(1,16)
Ausschüttungen	–	(0,39)	–	–	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	13,20	8,77	11,93	9,38	7,19
Gesamtertrag	(12,06 %)	(12,07 %)	(11,89 %)	(13,39 %)	(13,41 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen[++]	1,02 %	1,02 %	0,86 %	2,62 %	2,62 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,20 %	4,22 %	4,39 %	2,61 %	2,60 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt- Hard Currency2

	Thesaurierende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR I4* €	Thesaurierende Klasse EUR X €	Thesaurierende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I5 US$
31. Dezember 2023					
Eröffnungsnettoinventarwert	10,79	10,00	8,36	8,54	8,55
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,49	0,33	0,39	0,39	0,42
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,67	0,50	0,52	0,73	0,74
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,16	0,83	0,91	1,12	1,16
Schlussnettoinventarwert	11,95	10,83	9,27	9,66	9,71
Gesamtertrag	10,75 %	8,30 %	10,89 %	13,11 %	13,57 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen++	0,59 %	0,51 %	0,45 %	0,79 %	0,47 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,42 %	4,55 %	4,55 %	4,35 %	4,67 %
31. Dezember 2022					
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	–	10,00	10,00	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,12	–	0,36	0,34	0,36
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,67	–	(2,00)	(1,80)	(1,81)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,79	–	(1,64)	(1,46)	(1,45)
Schlussnettoinventarwert	10,79	–	8,36	8,54	8,55
Gesamtertrag	7,90 %	–	(16,40 %)	(14,60 %)	(14,50 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen++	0,61 %	–	0,45 %	0,89 %	0,53 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	4,22 %	–	4,46 %	4,13 %	4,61 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Tactical Macro[1]

	Thesaurierende Klasse USD I* US$	Thesaurierende Klasse USD I5* US$	Thesaurierende Klasse USD Z* US$
31. Dezember 2023			
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,01	0,10	0,06
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,21	0,14	0,20
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,22	0,24	0,26
Schlussnettoinventarwert	10,22	10,24	10,26
Gesamtertrag	2,20 %	2,40 %	2,60 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen[++]	0,97 %	0,70 %	0,18 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,31 %	2,02 %	1,13 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond

	Thesaurierende Klasse CHF P CHF	Thesaurierende Klasse CHF U CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Ausschüttende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	97,48	96,91	94,09	99,21	95,44	98,02
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	2,13	2,01	2,03	2,28	2,23	2,30
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	2,43	2,42	4,10	4,39	4,09	4,33
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	4,56	4,43	6,13	6,67	6,32	6,63
Ausschüttungen	–	–	–	–	(1,91)	–
Schlussnettoinventarwert	102,04	101,34	100,22	105,88	99,85	104,65
Gesamtertrag	4,68 %	4,57 %	6,52 %	6,72 %	6,71 %	6,76 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,26 %	0,37 %	0,48 %	0,28 %	0,28 %	0,24 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,14 %	2,03 %	2,09 %	2,24 %	2,30 %	2,28 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	100,00	102,92	99,83	105,08	102,73	103,78
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	1,20	1,71	1,46	1,80	1,82	1,80
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(3,72)	(7,72)	(7,20)	(7,67)	(7,54)	(7,56)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,52)	(6,01)	(5,74)	(5,87)	(5,72)	(5,76)
Ausschüttungen	–	–	–	–	(1,57)	–
Schlussnettoinventarwert	97,48	96,91	94,09	99,21	95,44	98,02
Gesamtertrag	(2,52 %)	(5,84 %)	(5,75 %)	(5,59 %)	(5,58 %)	(5,55 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,28 %	0,37 %	0,47 %	0,28 %	0,28 %	0,24 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,09 %	1,73 %	1,51 %	1,78 %	1,87 %	1,80 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I5 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR U €	Thesaurierende Klasse EUR Z €	Thesaurierende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	99,56	93,22	97,51	100,17	96,33	107,40
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	2,39	1,93	2,17	2,48	2,22	2,73
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	4,41	3,83	4,28	4,46	6,38	7,07
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	6,80	5,76	6,45	6,94	8,60	9,80
Schlussnettoinventarwert	106,36	98,98	103,96	107,11	104,93	117,20
Gesamtertrag	6,83 %	6,18 %	6,61 %	6,93 %	8,93 %	9,12 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,18 %	0,68 %	0,39 %	0,09 %	0,29 %	0,10 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,33 %	1,99 %	2,16 %	2,41 %	2,23 %	2,45 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	105,34	99,50	103,38	105,86	99,95	111,22
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	1,90	1,16	1,61	1,79	1,71	2,22
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(7,68)	(7,44)	(7,48)	(7,48)	(5,33)	(6,04)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,78)	(6,28)	(5,87)	(5,69)	(3,62)	(3,82)
Schlussnettoinventarwert	99,56	93,22	97,51	100,17	96,33	107,40
Gesamtertrag	(5,49 %)	(6,31 %)	(5,68 %)	(5,38 %)	(3,62 %)	(3,43 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,18 %	1,07 %	0,37 %	0,08 %	0,28 %	0,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,88 %	1,23 %	1,60 %	1,74 %	1,78 %	2,06 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies

	Thesaurierende Klasse CHF I CHF	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I2 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR P €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,34	10,07	10,51	10,85	9,83	9,85
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,06)	(0,14)	(0,07)	(0,05)	(0,20)	(0,07)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,21)	(0,99)	(1,04)	(1,08)	(0,97)	(0,95)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,27)	(1,13)	(1,11)	(1,13)	(1,17)	(1,02)
Schlussnettoinventarwert	9,07	8,94	9,40	9,72	8,66	8,83
Gesamtertrag	(12,28 %)	(11,22 %)	(10,56 %)	(10,41 %)	(11,90 %)	(10,36 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,78 %	2,60 %	1,81 %	1,73 %	3,40 %	1,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,62 %)	(1,44 %)	(0,69 %)	(0,51 %)	(2,19 %)	(0,72 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,72	9,52	9,86	10,16	9,37	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,40)	(0,45)	(0,43)	(0,38)	(0,41)	(0,07)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,02	1,00	1,08	1,07	0,87	(0,08)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,62	0,55	0,65	0,69	0,46	(0,15)
Schlussnettoinventarwert	10,34	10,07	10,51	10,85	9,83	9,85
Gesamtertrag	6,38 %	5,78 %	6,59 %	6,79 %	4,91 %	(1,50 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	4,09 %	4,66 %	4,22 %	4,81 %	4,67 %	2,02 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(3,87 %)	(4,47 %)	(4,08 %)	(3,56 %)	(4,23 %)	(1,39 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I £	Thesaurierende Klasse GBP I2 £	Ausschüttende Klasse GBP I2 £	Thesaurierende Klasse GBP I5 £	Thesaurierende Klasse GBP P £	Thesaurierende Klasse GBP Z £
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,52	11,56	9,96	11,74	11,16	12,02
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,08)	(0,05)	(0,03)	(0,04)	(0,06)	0,02
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,97)	(0,99)	(0,86)	(0,98)	(0,95)	(1,03)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,05)	(1,04)	(0,89)	(1,02)	(1,01)	(1,01)
Schlussnettoinventarwert	10,47	10,52	9,07	10,72	10,15	11,01
Gesamtertrag	(9,11 %)	(9,00 %)	(8,94 %)	(8,69 %)	(9,05 %)	(8,40 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,87 %	1,72 %	1,73 %	1,46 %	1,81 %	1,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,71 %)	(0,48 %)	(0,35 %)	(0,34 %)	(0,59 %)	0,15 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,61	10,63	10,00	10,77	10,27	10,98
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,40)	(0,41)	0,03	(0,35)	(0,41)	(0,36)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	1,31	1,34	(0,07)	1,32	1,30	1,40
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,91	0,93	(0,04)	0,97	0,89	1,04
Schlussnettoinventarwert	11,52	11,56	9,96	11,74	11,16	12,02
Gesamtertrag	8,58 %	8,75 %	(0,40 %)	9,01 %	8,67 %	9,47 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	3,89 %	3,89 %	0,19 %	3,39 %	4,02 %	3,32 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(3,58 %)	(3,62 %)	0,76 %	(3,05 %)	(3,71 %)	(3,06 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse JPY I ¥	Thesaurierende Klasse SGD A** SGD	Thesaurierende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD C1 US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I2 US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	1.029,89	19,98	11,03	10,57	11,97	12,01
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(5,93)	1,25	(0,14)	(0,23)	(0,07)	(0,05)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(136,10)	(1,88)	(0,91)	(0,88)	(0,99)	(0,99)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(142,03)	(0,63)	(1,05)	(1,11)	(1,06)	(1,04)
Schlussnettoinventarwert	887,86	19,35	9,98	9,46	10,91	10,97
Gesamtertrag	(13,79 %)	(3,25 %)***	(9,52 %)	(10,50 %)	(8,86 %)	(8,66 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,94 %	44,14 %	2,67 %	3,67 %	1,93 %	1,77 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,63 %)	8,84 %	(1,40 %)	(2,39 %)	(0,62 %)	(0,47 %)

**Wiederaufnahme der Geschäfte am Dienstag, 13. April 2023.

*** Die Gesamtrendite für den Zeitraum von 1. Januar 2023 bis 5. April 2023 betrug (6,97 %).

31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	1.000,00	20,00	10,26	9,92	11,05	11,07
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(11,88)	0,00	(0,39)	(0,58)	(0,40)	(0,44)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	41,77	0,11	1,16	1,23	1,32	1,38
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	29,89	0,11	0,77	0,65	0,92	0,94
Schlussnettoinventarwert	1.029,89	20,11	11,03	10,57	11,97	12,01
Gesamtertrag	2,99 %	0,55 %	7,50 %	6,55 %	8,33 %	8,49 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	2,08 %	2,22 %	4,02 %	5,76 %	3,69 %	3,97 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,53 %)	(0,57 %)	(3,62 %)	(5,52 %)	(3,36 %)	(3,73 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I5 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD P US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023				
Eröffnungsnettoinventarwert	12,22	10,89	11,66	12,32
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,03)	(0,23)	(0,08)	0,01
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,01)	(0,89)	(0,96)	(1,02)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,04)	(1,12)	(1,04)	(1,01)
Schlussnettoinventarwert	11,18	9,77	10,62	11,31
Gesamtertrag	(8,51 %)	(10,28 %)	(8,92 %)	(8,20 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	1,52 %	3,47 %	1,82 %	1,15 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,23 %)	(2,22 %)	(0,69 %)	0,09 %
31. Dezember 2022				
Eröffnungsnettoinventarwert	11,24	10,21	10,76	11,28
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,36)	(0,52)	(0,29)	(0,25)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,34	1,20	1,19	1,29
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,98	0,68	0,90	1,04
Schlussnettoinventarwert	12,22	10,89	11,66	12,32
Gesamtertrag	8,72 %	6,66 %	8,36 %	9,22 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	3,28 %	5,14 %	3,03 %	2,47 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,97 %)	(4,80 %)	(2,53 %)	(2,04 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity

	Thesaurierende Klasse JPY I3 ¥	Thesaurierende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD M US$
31. Dezember 2023					
Eröffnungsnettoinventarwert	816,04	13,76	20,34	20,18	7,74
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,97	(0,14)	(0,03)	(0,03)	(0,15)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	241,05	5,07	7,52	7,47	2,84
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	242,02	4,93	7,49	7,44	2,69
Schlussnettoinventarwert	1.058,06	18,69	27,83	27,62	10,43
Gesamtertrag	29,66 %	35,83 %	36,82 %	36,87 %	34,75 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen[++]	0,74 %	1,72 %	0,97 %	0,97 %	2,54 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,10 %	(0,87 %)	(0,12 %)	(0,12 %)	(1,63 %)
31. Dezember 2022					
Eröffnungsnettoinventarwert	1.000,00	18,74	27,49	27,28	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:					
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	1,47	(0,12)	(0,02)	(0,02)	(0,12)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(185,43)	(4,86)	(7,13)	(7,08)	(2,14)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(183,96)	(4,98)	(7,15)	(7,10)	(2,26)
Schlussnettoinventarwert	816,04	13,76	20,34	20,18	7,74
Gesamtertrag	(18,40 %)	(26,57 %)	(26,01 %)	(26,03 %)	(22,60 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen					
Aufwendungen[++]	0,73 %	1,72 %	0,97 %	0,97 %	2,52 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,21 %	(0,81 %)	(0,08 %)	(0,10 %)	(1,58 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite

	Thesaurierende Klasse EUR I	Ausschüttende Klasse EUR I3	Thesaurierende Klasse EUR I4	Ausschüttende Klasse EUR I4*	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)
	€	€	€	€	€	£
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,69	8,83	11,65	10,00	10,76	13,58
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,10	0,05	0,07	0,01	(0,11)	0,04
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,40	1,10	1,46	0,06	1,33	1,17
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,50	1,15	1,53	0,07	1,22	1,21
Ausschüttungen	–	(0,03)	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	13,19	9,95	13,18	10,07	11,98	14,79
Gesamtertrag	12,83 %	13,03 %	13,13 %	0,70 %	11,34 %	8,91 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,72 %	0,52 %	0,46 %	0,46 %	2,07 %	0,69 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,76 %	0,56 %	0,58 %	1,92 %	(0,98 %)	0,27 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	13,45	10,38	13,37	–	12,56	13,50
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,00	0,02	0,03	–	(0,16)	0,00
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,76)	(1,35)	(1,75)	–	(1,64)	0,08
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,76)	(1,33)	(1,72)	–	(1,80)	0,08
Ausschüttungen	–	(0,22)	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,69	8,83	11,65	–	10,76	13,58
Gesamtertrag	(13,09 %)	(12,93 %)	(12,86 %)	–	(14,33 %)	0,59 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,70 %	0,52 %	0,46 %	–	2,08 %	0,73 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,00	0,17 %	0,24 %	–	(1,38 %)	0,00

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I3	Ausschüttende Klasse GBP I3	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I4*	Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)
	£	£	£	£	£	£
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,58	9,40	10,00	14,05	10,00	10,06
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,07	0,06	0,05	0,09	0,01	0,04
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,98	1,33	0,45	1,19	0,23	0,84
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,05	1,39	0,50	1,28	0,24	0,88
Ausschüttungen	–	(0,03)	(0,02)	–	–	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	12,63	10,76	10,48	15,33	10,24	10,53
Gesamtertrag	9,07 %	14,82 %	5,00 %	9,11 %	2,40 %	8,96 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,52 %	0,52 %	0,51 %	0,46 %	0,49 %	0,66 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,61 %	0,58 %	0,94 %	0,59 %	1,61 %	0,38 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,49	10,90	–	13,93	–	10,40
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,02	0,02	–	0,03	–	0,00
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,07	(1,29)	–	0,09	–	0,07
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,09	(1,27)	–	0,12	–	0,07
Ausschüttungen	–	(0,23)	–	–	–	(0,41)
Schlussnettoinventarwert	11,58	9,40	–	14,05	–	10,06
Gesamtertrag	0,78 %	(11,73 %)	–	0,86 %	–	0,64 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,54 %	0,54 %	–	0,48 %	–	0,70 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,19 %	0,17 %	–	0,24 %	–	0,03 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I3	Thesaurierende Klasse USD I4
	SGD	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	18,85	13,06	10,55	13,71	9,09	13,29
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,04)	(0,03)	0,02	0,06	0,06	0,09
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	2,46	1,95	1,57	2,05	1,35	1,99
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,42	1,92	1,59	2,11	1,41	2,08
Ausschüttungen	(0,89)	–	(0,50)	–	(0,03)	–
Schlussnettoinventarwert	20,38	14,98	11,64	15,82	10,47	15,37
Gesamtertrag	13,13 %	14,70 %	15,43 %	15,39 %	15,53 %	15,65 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,29 %	1,31 %	0,70 %	0,71 %	0,53 %	0,47 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,23 %)	(0,19 %)	0,16 %	0,41 %	0,60 %	0,65 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	22,21	14,70	12,29	15,34	10,39	14,84
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,12)	(0,08)	0,00	0,00	0,02	0,03
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(2,44)	(1,56)	(1,30)	(1,63)	(1,10)	(1,58)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(2,56)	(1,64)	(1,30)	(1,63)	(1,08)	(1,55)
Ausschüttungen	(0,80)	–	(0,44)	–	(0,22)	–
Schlussnettoinventarwert	18,85	13,06	10,55	13,71	9,09	13,29
Gesamtertrag	(11,67 %)	(11,16 %)	(10,66 %)	(10,63 %)	(10,45 %)	(10,44 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,27 %	1,31 %	0,71 %	0,71 %	0,53 %	0,47 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,59 %)	(0,60 %)	(0,01 %)	0,00 %	0,17 %	0,25 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023		
Eröffnungsnettoinventarwert	12,32	13,87
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,14)	0,16
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,84	2,07
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,70	2,23
Schlussnettoinventarwert	14,02	16,10
Gesamtertrag	13,80 %	16,08 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	2,12 %	0,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,03 %)	1,04 %
31. Dezember 2022		
Eröffnungsnettoinventarwert	13,98	15,43
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,18)	0,08
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,48)	(1,64)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,66)	(1,56)
Schlussnettoinventarwert	12,32	13,87
Gesamtertrag	(11,87 %)	(10,11 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	2,11 %	0,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,40 %)	0,59 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value

	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)
	€	€	€	€	€	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,87	10,68	9,20	9,42	9,91	10,42
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,06	0,06	0,12	0,13	0,15	0,17
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,68)	(0,78)	(0,57)	(0,69)	(0,70)	(0,75)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,62)	(0,72)	(0,45)	(0,56)	(0,55)	(0,58)
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,10)	–
Schlussnettoinventarwert	10,25	9,96	8,75	8,86	9,26	9,84
Gesamtertrag	(5,70 %)	(6,74 %)	(4,89 %)	(5,94 %)	(5,62 %)	(5,57 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,56 %	1,55 %	0,78 %	0,78 %	0,50 %	0,43 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,62 %	0,60 %	1,40 %	1,42 %	1,64 %	1,71 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,01	0,02	0,08	0,07	0,10	0,14
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,86	0,66	(0,88)	(0,65)	(0,19)	0,28
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,87	0,68	(0,80)	(0,58)	(0,09)	0,42
Schlussnettoinventarwert	10,87	10,68	9,20	9,42	9,91	10,42
Gesamtertrag	8,70 %	6,80 %	(8,00 %)	(5,80 %)	(0,90 %)	4,20 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,62 %	1,57 %	0,76 %	0,75 %	0,48 %	0,43 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,38 %	0,33 %	1,19 %	1,12 %	1,33 %	1,44 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse GBP I	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I	Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)
	£	£	£	£	£	£
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	9,76	9,66	9,76	9,66	10,92	10,28
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,13	0,13	0,13	0,13	0,17	0,13
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,46)	(0,91)	(0,46)	(0,92)	(1,02)	(0,97)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,33)	(0,78)	(0,33)	(0,79)	(0,85)	(0,84)
Ausschüttungen	–	–	(0,01)	(0,01)	(0,11)	–
Schlussnettoinventarwert	9,43	8,88	9,42	8,86	9,96	9,44
Gesamtertrag	(3,38 %)	(8,07 %)	(3,39 %)	(8,20 %)	(7,87 %)	(8,17 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,76 %	0,79 %	0,79 %	0,78 %	0,50 %	0,75 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,37 %	1,43 %	1,41 %	1,41 %	1,64 %	1,40 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,01	0,01	0,01	0,01	0,12	0,07
Realisierter und nicht realisierter Netto-gewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,25)	(0,35)	(0,25)	(0,35)	0,80	0,21
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,24)	(0,34)	(0,24)	(0,34)	0,92	0,28
Schlussnettoinventarwert	9,76	9,66	9,76	9,66	10,92	10,28
Gesamtertrag	(2,40 %)	(3,40 %)	(2,40 %)	(3,40 %)	9,20 %	2,80 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,86 %	0,87 %	0,86 %	0,87 %	0,50 %	0,77 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,94 %	0,94 %	0,94 %	0,94 %	1,39 %	1,22 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP P	Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I4
	£	£	£	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,63	10,48	10,29	9,50	10,28	9,63
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,14	0,14	0,14	0,06	0,14	0,16
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,50)	(0,99)	(0,96)	(0,38)	(0,41)	(0,38)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,36)	(0,85)	(0,82)	(0,32)	(0,27)	(0,22)
Ausschüttungen	(0,02)	–	(0,04)	–	–	(0,10)
Schlussnettoinventarwert	10,25	9,63	9,43	9,18	10,01	9,31
Gesamtertrag	(3,37 %)	(8,11 %)	(8,02 %)	(3,37 %)	(2,63 %)	(2,34 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,73 %	0,71 %	0,71 %	1,59 %	0,79 %	0,51 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,41 %	1,44 %	1,51 %	0,60 %	1,40 %	1,67 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	10,00	10,00	10,39	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,02	0,08	0,04	0,03	0,11	0,10
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,61	0,40	0,25	(0,53)	(0,22)	(0,47)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,63	0,48	0,29	(0,50)	(0,11)	(0,37)
Schlussnettoinventarwert	10,63	10,48	10,29	9,50	10,28	9,63
Gesamtertrag	6,30 %	4,80 %	2,90 %	(5,00 %)	(1,06 %)	(3,70 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,78 %	0,71 %	0,72 %	1,59 %	0,80 %	0,50 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,16 %	1,37 %	1,18 %	0,39 %	1,16 %	1,40 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I5 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD Y* US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023				
Eröffnungsnettoinventarwert	9,65	9,35	10,00	10,10
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,16	(0,02)	0,06	0,21
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,38)	(0,38)	(0,17)	(0,41)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,22)	(0,40)	(0,11)	(0,20)
Schlussnettoinventarwert	9,43	8,95	9,89	9,90
Gesamtertrag	(2,28 %)	(4,28 %)	(1,10 %)	(1,98 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	0,44 %	2,39 %	0,75 %	0,08 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,74 %	(0,21 %)	1,54 %	2,11 %
31. Dezember 2022				
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	10,00	–	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:				
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,13	(0,03)	–	0,11
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,48)	(0,62)	–	(0,01)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,35)	(0,65)	–	0,10
Schlussnettoinventarwert	9,65	9,35	–	10,10
Gesamtertrag	(3,50 %)	(6,50 %)	–	1,00 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen				
Aufwendungen[++]	0,44 %	2,40 %	–	0,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,56 %	(0,42 %)	–	1,85 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity

	Thesaurierende Klasse EUR A €	Thesaurierende Klasse EUR I €	Thesaurierende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Ausschüttende Klasse GBP I3 £	Thesaurierende Klasse SGD A1 SGD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,40	11,22	10,54	10,21	10,08	24,13
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,08)	0,02	0,06	(0,16)	0,06	(0,08)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,12	1,22	1,15	1,09	1,27	2,81
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,04	1,24	1,21	0,93	1,33	2,73
Ausschüttungen	–	–	–	–	(0,07)	–
Schlussnettoinventarwert	11,44	12,46	11,75	11,14	11,34	26,86
Gesamtertrag	10,00 %	11,05 %	11,48 %	9,11 %	13,23 %	11,31 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,40 %	1,50 %	1,13 %	3,19 %	1,15 %	2,03 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,71 %)	0,19 %	0,56 %	(1,50 %)	0,54 %	(0,32 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,66	12,47	11,67	11,53	10,98	26,43
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,12)	(0,03)	0,01	(0,20)	0,01	(0,22)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,14)	(1,22)	(1,14)	(1,12)	(0,91)	(2,08)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,26)	(1,25)	(1,13)	(1,32)	(0,90)	(2,30)
Schlussnettoinventarwert	10,40	11,22	10,54	10,21	10,08	24,13
Gesamtertrag	(10,81 %)	(10,02 %)	(9,68 %)	(11,45 %)	(8,20 %)	(8,70 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,41 %	1,51 %	1,11 %	3,19 %	1,17 %	2,13 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,13 %)	(0,24 %)	0,11 %	(1,90 %)	0,05 %	(0,88 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD A (PF)	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD A1	Ausschüttende Klasse USD I (PF)	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I3
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,72	11,86	12,63	12,33	13,49	10,99
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,08)	(0,09)	(0,04)	(0,04)	0,03	0,07
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,52	1,56	1,65	1,62	1,77	1,45
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,44	1,47	1,61	1,58	1,80	1,52
Ausschüttungen	–	–	–	(0,08)	–	–
Schlussnettoinventarwert	13,16	13,33	14,24	13,83	15,29	12,51
Gesamtertrag	12,29 %	12,39 %	12,75 %	12,83 %	13,34 %	13,83 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,38 %	2,46 %	2,06 %	2,02 %	1,56 %	1,15 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,65 %)	(0,73 %)	(0,33 %)	(0,29 %)	0,18 %	0,59 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,74	12,97	13,77	13,31	14,61	11,85
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,06)	(0,14)	(0,11)	0,02	(0,02)	0,01
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,96)	(0,97)	(1,03)	(1,00)	(1,10)	(0,87)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,02)	(1,11)	(1,14)	(0,98)	(1,12)	(0,86)
Schlussnettoinventarwert	11,72	11,86	12,63	12,33	13,49	10,99
Gesamtertrag	(8,01 %)	(8,56 %)	(8,28 %)	(7,36 %)	(7,67 %)	(7,26 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,89 %	2,44 %	2,19 %	1,18 %	1,53 %	1,11 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,54 %)	(1,11 %)	(0,86 %)	0,16 %	(0,14 %)	0,11 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD U US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023			
Eröffnungsnettoinventarwert	10,98	12,39	14,90
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,18)	(0,03)	0,24
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,44	1,63	1,99
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,26	1,60	2,23
Schlussnettoinventarwert	12,24	13,99	17,13
Gesamtertrag	11,48 %	12,91 %	14,97 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen[++]	3,26 %	2,00 %	0,21 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,54 %)	(0,23 %)	1,52 %
31. Dezember 2022			
Eröffnungsnettoinventarwert	12,11	13,49	15,93
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:			
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,21)	(0,08)	0,17
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(0,92)	(1,02)	(1,20)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,13)	(1,10)	(1,03)
Schlussnettoinventarwert	10,98	12,39	14,90
Gesamtertrag	(9,33 %)	(8,15 %)	(6,47 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen			
Aufwendungen[++]	3,23 %	1,98 %	0,19 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(1,89 %)	(0,65 %)	1,10 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities

	Thesaurierende Klasse AUD E AUD	Thesaurierende Klasse AUD T AUD	Thesaurierende Klasse EUR I3 €	Thesaurierende Klasse EUR M €	Thesaurierende Klasse EUR1 A €	Thesaurierende Klasse EUR1 I €
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	16,18	15,19	22,53	15,91	25,08	27,36
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,35)	(0,17)	0,04	(0,33)	(0,26)	(0,05)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	2,50	2,36	3,49	2,42	3,85	4,22
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,15	2,19	3,53	2,09	3,59	4,17
Schlussnettoinventarwert	18,33	17,38	26,06	18,00	28,67	31,53
Gesamtertrag	13,29 %	14,42 %	15,67 %	13,14 %	14,31 %	15,24 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,92 %	1,94 %	0,68 %	2,84 %	1,86 %	1,02 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,06 %)	(1,08 %)	0,18 %	(1,98 %)	(0,99 %)	(0,16 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	20,43	18,99	28,01	20,22	31,56	34,13
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,36)	(0,17)	0,06	(0,33)	(0,25)	(0,03)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(3,89)	(3,63)	(5,54)	(3,98)	(6,23)	(6,74)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,25)	(3,80)	(5,48)	(4,31)	(6,48)	(6,77)
Schlussnettoinventarwert	16,18	15,19	22,53	15,91	25,08	27,36
Gesamtertrag	(20,80 %)	(20,01 %)	(19,56 %)	(21,32 %)	(20,53 %)	(19,84 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	3,01 %	1,99 %	0,64 %	2,81 %	1,82 %	0,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,09 %)	(1,07 %)	0,24 %	(1,93 %)	(0,94 %)	(0,11 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse SGD A	Thesaurierende Klasse USD B	Thesaurierende Klasse USD C1	Thesaurierende Klasse USD C2	Thesaurierende Klasse USD E
	£	SGD	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	16,38	42,26	17,80	13,62	17,80	16,75
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,03	(0,44)	(0,40)	(0,29)	(0,40)	(0,38)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	1,89	6,89	3,21	2,46	3,22	3,03
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,92	6,45	2,81	2,17	2,82	2,65
Ausschüttungen	(0,04)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	18,26	48,71	20,61	15,79	20,62	19,40
Gesamtertrag	11,77 %	15,26 %	15,79 %	15,93 %	15,84 %	15,82 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,67 %	1,86 %	3,00 %	2,90 %	2,99 %	3,00 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,20 %	(0,99 %)	(2,10 %)	(2,01 %)	(2,15 %)	(2,11 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	17,50	51,87	21,90	16,74	21,89	20,60
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,04	(0,41)	(0,38)	(0,28)	(0,38)	(0,36)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(1,14)	(9,20)	(3,72)	(2,84)	(3,71)	(3,49)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,10)	(9,61)	(4,10)	(3,12)	(4,09)	(3,85)
Ausschüttungen	(0,02)	–	–	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	16,38	42,26	17,80	13,62	17,80	16,75
Gesamtertrag	(6,27 %)	(18,53 %)	(18,72 %)	(18,64 %)	(18,68 %)	(18,69 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,66 %	1,80 %	2,95 %	2,85 %	2,95 %	2,95 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,22 %	(0,93 %)	(2,06 %)	(1,96 %)	(2,06 %)	(2,05 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I2* US$	Thesaurierende Klasse USD I3 US$	Ausschüttende Klasse USD I3 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD T US$	Thesaurierende Klasse USD U US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,00	26,14	23,44	18,95	19,51	26,82
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,01	0,05	0,05	(0,41)	(0,23)	(0,16)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	1,19	4,78	4,28	3,43	3,53	4,88
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,20	4,83	4,33	3,02	3,30	4,72
Ausschüttungen	–	–	(0,06)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	11,20	30,97	27,71	21,97	22,81	31,54
Gesamtertrag	12,00 %	18,48 %	18,52 %	15,94 %	16,91 %	17,60 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,85 %	0,70 %	0,70 %	2,90 %	2,00 %	1,45 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,10 %	0,17 %	0,19 %	(2,02 %)	(1,11 %)	(0,56 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	–	31,41	28,22	23,28	23,75	32,48
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	–	0,06	0,06	(0,40)	(0,21)	(0,14)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	–	(5,33)	(4,80)	(3,93)	(4,03)	(5,52)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	–	(5,27)	(4,74)	(4,33)	(4,24)	(5,66)
Ausschüttungen	–	–	(0,04)	–	–	–
Schlussnettoinventarwert	–	26,14	23,44	18,95	19,51	26,82
Gesamtertrag	–	(16,78 %)	(16,82 %)	(18,60 %)	(17,85 %)	(17,43 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	–	0,65 %	0,65 %	2,85 %	1,95 %	1,40 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	–	0,23 %	0,24 %	(2,00 %)	(1,05 %)	(0,51 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD Z US$	Thesaurierende Klasse USD1 A US$	Thesaurierende Klasse USD1 I US$	Ausschüttende Klasse USD1 I US$	Thesaurierende Klasse ZAR B ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR C2 ZAR
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	22,06	29,24	32,71	31,57	258,68	257,19
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,16	(0,32)	(0,06)	(0,05)	(5,83)	(5,89)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	4,05	5,31	5,98	5,75	54,07	53,98
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	4,21	4,99	5,92	5,70	48,24	48,09
Schlussnettoinventarwert	26,27	34,23	38,63	37,27	306,92	305,28
Gesamtertrag	19,08 %	17,07 %	18,10 %	18,06 %	18,65 %	18,70 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,20 %	1,90 %	1,05 %	1,05 %	2,97 %	2,97 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,69 %	(1,02 %)	(0,17 %)	(0,14 %)	(2,09 %)	(2,14 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	26,38	35,57	39,46	38,08	310,31	308,51
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,17	(0,29)	(0,04)	(0,04)	(5,76)	(5,81)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(4,49)	(6,04)	(6,71)	(6,47)	(45,87)	(45,51)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,32)	(6,33)	(6,75)	(6,51)	(51,63)	(51,32)
Schlussnettoinventarwert	22,06	29,24	32,71	31,57	258,68	257,19
Gesamtertrag	(16,38 %)	(17,80 %)	(17,11 %)	(17,10 %)	(16,64 %)	(16,63 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,15 %	1,85 %	1,00 %	1,00 %	3,06 %	3,06 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,75 %	(0,96 %)	(0,12 %)	(0,12 %)	(2,14 %)	(2,13 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR
31. Dezember 2023		
Eröffnungsnettoinventarwert	238,22	283,17
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(5,39)	(3,40)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	49,81	59,57
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	44,42	56,17
Schlussnettoinventarwert	282,64	339,34
Gesamtertrag	18,65 %	19,84 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	2,96 %	1,98 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,10 %)	(1,11 %)
31. Dezember 2022		
Eröffnungsnettoinventarwert	285,76	336,29
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(5,27)	(3,19)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(42,27)	(49,93)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(47,54)	(53,12)
Schlussnettoinventarwert	238,22	283,17
Gesamtertrag	(16,64 %)	(15,80 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	3,06 %	2,03 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,13 %)	(1,09 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities

	Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich) AUD	Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD B AUD	Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich) AUD	Thesaurierende Klasse AUD E AUD	Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich) AUD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	8,13	7,53	11,22	7,52	12,14	8,74
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,09	(0,01)	(0,01)	(0,01)	(0,03)	0,08
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,46	0,42	0,65	0,42	0,72	0,49
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,55	0,41	0,64	0,41	0,69	0,57
Ausschüttungen	(0,32)	(0,30)	–	(0,30)	–	(0,35)
Schlussnettoinventarwert	8,36	7,64	11,86	7,63	12,83	8,96
Gesamtertrag	7,12 %	5,69 %	5,70 %	5,70 %	5,68 %	6,79 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,68 %	2,94 %	2,94 %	2,94 %	2,96 %	1,95 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,12 %	(0,17 %)	(0,12 %)	(0,10 %)	(0,28 %)	0,89 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	12,16	11,41	16,33	11,40	17,67	13,11
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,07	(0,06)	(0,08)	(0,05)	(0,09)	0,04
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(3,70)	(3,45)	(5,03)	(3,46)	(5,44)	(3,98)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,63)	(3,51)	(5,11)	(3,51)	(5,53)	(3,94)
Ausschüttungen	(0,40)	(0,37)	–	(0,37)	–	(0,43)
Schlussnettoinventarwert	8,13	7,53	11,22	7,52	12,14	8,74
Gesamtertrag	(30,39 %)	(31,29 %)	(31,29 %)	(31,32 %)	(31,30 %)	(30,59 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,78 %	3,11 %	3,11 %	3,11 %	3,11 %	2,09 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,73 %	(0,60 %)	(0,63 %)	(0,55 %)	(0,60 %)	0,41 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse AUD T	Thesaurierende Klasse CHF A	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR M	Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)
	AUD	CHF	€	€	€	HKD
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	14,37	13,32	7,98	17,63	10,78	8,82
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,12	0,15	0,09	0,34	0,02	0,10
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	0,84	0,52	0,47	1,04	0,62	0,63
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,96	0,67	0,56	1,38	0,64	0,73
Ausschüttungen	–	–	–	–	–	(0,35)
Schlussnettoinventarwert	15,33	13,99	8,54	19,01	11,42	9,20
Gesamtertrag	6,68 %	5,03 %	7,02 %	7,83 %	5,94 %	8,62 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,96 %	1,59 %	1,67 %	0,93 %	2,65 %	1,70 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,84 %	1,11 %	1,17 %	1,92 %	0,21 %	1,15 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	20,70	19,35	11,56	25,33	15,75	12,92
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	0,08	0,11	0,02	0,22	(0,02)	0,07
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(6,41)	(6,14)	(3,60)	(7,92)	(4,95)	(3,74)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(6,33)	(6,03)	(3,58)	(7,70)	(4,97)	(3,67)
Ausschüttungen	–	–	–	–	–	(0,43)
Schlussnettoinventarwert	14,37	13,32	7,98	17,63	10,78	8,82
Gesamtertrag	(30,58 %)	(31,16 %)	(30,97 %)	(30,40 %)	(31,56 %)	(28,92 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	2,09 %	1,69 %	1,71 %	0,97 %	2,71 %	1,74 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,47 %	0,69 %	0,20 %	1,00 %	(0,15 %)	0,71 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse SGD A	Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD A	Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD B
	SGD	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	27,99	10,15	21,92	15,81	8,45	13,48
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,32	0,12	0,26	0,19	(0,01)	(0,02)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	1,90	0,82	1,87	1,32	0,69	1,14
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,22	0,94	2,13	1,51	0,68	1,12
Ausschüttungen	–	(0,40)	–	(0,17)	(0,34)	–
Schlussnettoinventarwert	30,21	10,69	24,05	17,15	8,79	14,60
Gesamtertrag	7,93 %	9,67 %	9,72 %	9,70 %	8,32 %	8,31 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,69 %	1,70 %	1,70 %	1,70 %	3,01 %	3,01 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,14 %	1,18 %	1,20 %	1,20 %	(0,12 %)	(0,15 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	39,53	14,78	30,68	22,25	12,47	19,11
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,20	0,08	0,18	0,13	(0,06)	(0,09)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(11,74)	(4,22)	(8,94)	(6,47)	(3,55)	(5,54)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(11,54)	(4,14)	(8,76)	(6,34)	(3,61)	(5,63)
Ausschüttungen	–	(0,49)	–	(0,10)	(0,41)	–
Schlussnettoinventarwert	27,99	10,15	21,92	15,81	8,45	13,48
Gesamtertrag	(29,19 %)	(28,50 %)	(28,55 %)	(28,53 %)	(29,45 %)	(29,46 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,70 %	1,75 %	1,75 %	1,75 %	3,05 %	3,05 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,61 %	0,69 %	0,72 %	0,71 %	(0,57 %)	(0,58 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD C1	Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD E	Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD I	Ausschüttende Klasse USD I
	US$	US$	US$	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,25	8,45	12,79	8,69	24,75	14,51
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,02	(0,01)	(0,02)	0,17	0,48	0,29
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,95	0,69	1,08	0,71	2,13	1,22
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,97	0,68	1,06	0,88	2,61	1,51
Ausschüttungen	–	(0,34)	–	(0,35)	–	(0,27)
Schlussnettoinventarwert	12,22	8,79	13,85	9,22	27,36	15,75
Gesamtertrag	8,62 %	8,32 %	8,29 %	10,48 %	10,55 %	10,62 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	2,71 %	3,01 %	3,01 %	0,95 %	0,95 %	0,95 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	0,18 %	(0,12 %)	(0,16 %)	1,98 %	1,93 %	1,98 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	15,90	12,47	18,13	12,56	34,38	20,43
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,05)	(0,06)	(0,09)	0,15	0,42	0,25
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(4,60)	(3,55)	(5,25)	(3,60)	(10,05)	(5,94)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,65)	(3,61)	(5,34)	(3,45)	(9,63)	(5,69)
Ausschüttungen	–	(0,41)	–	(0,42)	–	(0,23)
Schlussnettoinventarwert	11,25	8,45	12,79	8,69	24,75	14,51
Gesamtertrag	(29,25 %)	(29,45 %)	(29,45 %)	(27,96 %)	(28,01 %)	(28,01 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	2,74 %	3,05 %	3,04 %	1,00 %	1,00 %	1,00 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,34 %)	(0,61 %)	(0,62 %)	1,44 %	1,46 %	1,50 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I2	Thesaurierende Klasse USD M	Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse USD T	Thesaurierende Klasse USD Z	Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)
	US$	US$	US$	US$	US$	ZAR
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	18,19	13,12	9,72	14,79	14,36	78,11
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,40	0,02	0,09	0,13	0,36	(0,11)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	1,56	1,11	0,79	1,26	1,28	7,78
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,96	1,13	0,88	1,39	1,64	7,67
Ausschüttungen	–	–	(0,39)	–	–	(5,77)
Schlussnettoinventarwert	20,15	14,25	10,21	16,18	16,00	80,01
Gesamtertrag	10,78 %	8,61 %	9,38 %	9,40 %	11,42 %	10,53 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,74 %	2,71 %	2,01 %	2,00 %	0,22 %	2,99 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	2,19 %	0,17 %	0,90 %	0,90 %	2,49 %	(0,14 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	25,22	18,55	14,20	20,76	19,79	117,12
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	0,38	(0,05)	0,05	0,07	0,35	(0,55)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(7,41)	(5,38)	(4,06)	(6,04)	(5,78)	(30,67)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(7,03)	(5,43)	(4,01)	(5,97)	(5,43)	(31,22)
Ausschüttungen	–	–	(0,47)	–	–	(7,79)
Schlussnettoinventarwert	18,19	13,12	9,72	14,79	14,36	78,11
Gesamtertrag	(27,87 %)	(29,27 %)	(28,73 %)	(28,76 %)	(27,44 %)	(27,64 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,81 %	2,75 %	2,05 %	2,05 %	0,24 %	3,16 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	1,90 %	(0,30 %)	0,44 %	0,42 %	2,09 %	(0,58 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR B	Thesaurierende Klasse ZAR C2	Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR E	Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	Thesaurierende Klasse ZAR T
	ZAR	ZAR	ZAR	ZAR	ZAR	ZAR
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	162,51	160,47	78,12	181,81	120,20	223,40
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,23)	(0,34)	(0,10)	(0,32)	1,02	1,93
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	17,37	17,28	7,77	19,50	12,05	24,13
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	17,14	16,94	7,67	19,18	13,07	26,06
Ausschüttungen	–	–	(5,77)	–	(8,91)	–
Schlussnettoinventarwert	179,65	177,41	80,02	200,99	124,36	249,46
Gesamtertrag	10,55 %	10,56 %	10,53 %	10,55 %	11,63 %	11,67 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	3,01 %	3,02 %	3,00 %	3,00 %	1,99 %	1,99 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,14 %)	(0,21 %)	(0,14 %)	(0,17 %)	0,87 %	0,85 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	224,68	221,86	117,13	251,37	178,43	305,79
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(1,15)	(1,13)	(0,53)	(1,16)	0,61	1,28
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(61,02)	(60,26)	(30,69)	(68,40)	(46,92)	(83,67)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(62,17)	(61,39)	(31,22)	(69,56)	(46,31)	(82,39)
Ausschüttungen	–	–	(7,79)	–	(11,92)	–
Schlussnettoinventarwert	162,51	160,47	78,12	181,81	120,20	223,40
Gesamtertrag	(27,67 %)	(27,67 %)	(27,63 %)	(27,67 %)	(26,91 %)	(26,94 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	3,16 %	3,16 %	3,16 %	3,16 %	2,12 %	2,13 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,60 %)	(0,60 %)	(0,56 %)	(0,55 %)	0,42 %	0,50 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap

	Thesaurierende Klasse AUD B	Thesaurierende Klasse AUD C2	Thesaurierende Klasse AUD E	Thesaurierende Klasse AUD T	Thesaurierende Klasse EUR A	Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)
	AUD	AUD	AUD	AUD	€	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,86	10,59	15,20	14,04	15,29	12,63
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,24)	(0,23)	(0,33)	(0,17)	(0,17)	(0,14)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	1,37	1,34	1,91	1,79	1,92	1,46
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,13	1,11	1,58	1,62	1,75	1,32
Schlussnettoinventarwert	11,99	11,70	16,78	15,66	17,04	13,95
Gesamtertrag	10,41 %	10,48 %	10,39 %	11,54 %	11,45 %	10,45 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	2,86 %	2,83 %	2,86 %	1,89 %	1,80 %	1,81 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,09 %)	(2,09 %)	(2,09 %)	(1,13 %)	(1,05 %)	(1,06 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	14,09	13,74	19,71	18,03	19,76	14,80
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,27)	(0,26)	(0,38)	(0,19)	(0,19)	(0,14)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(2,96)	(2,89)	(4,13)	(3,80)	(4,28)	(2,03)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(3,23)	(3,15)	(4,51)	(3,99)	(4,47)	(2,17)
Schlussnettoinventarwert	10,86	10,59	15,20	14,04	15,29	12,63
Gesamtertrag	(22,92 %)	(22,93 %)	(22,88 %)	(22,13 %)	(22,62 %)	(14,66 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	3,01 %	2,98 %	3,01 %	1,99 %	1,82 %	1,81 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,33 %)	(2,27 %)	(2,33 %)	(1,29 %)	(1,15 %)	(1,09 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse EUR I	Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse EUR M	Thesaurierende Klasse EUR Z
	€	€	€	€	€	€
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	18,08	16,36	15,26	9,86	15,49	17,10
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,03)	(0,03)	(0,01)	0,01	(0,32)	0,11
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	2,28	1,90	1,77	1,15	1,93	2,18
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	2,25	1,87	1,76	1,16	1,61	2,29
Schlussnettoinventarwert	20,33	18,23	17,02	11,02	17,10	19,39
Gesamtertrag	12,44 %	11,43 %	11,53 %	11,76 %	10,39 %	13,39 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,97 %	0,97 %	0,80 %	0,64 %	2,79 %	0,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,18 %)	(0,19 %)	(0,08 %)	0,14 %	(1,99 %)	0,63 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	23,17	19,01	17,70	10,00	20,22	21,73
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,08)	(0,05)	(0,02)	0,01	(0,35)	0,10
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(5,01)	(2,60)	(2,42)	(0,15)	(4,38)	(4,73)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(5,09)	(2,65)	(2,44)	(0,14)	(4,73)	(4,63)
Schlussnettoinventarwert	18,08	16,36	15,26	9,86	15,49	17,10
Gesamtertrag	(21,97 %)	(13,94 %)	(13,79 %)	(1,40 %)	(23,39 %)	(21,31 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,99 %	0,98 %	0,81 %	0,62 %	2,80 %	0,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,38 %)	(0,28 %)	(0,13 %)	0,15 %	(2,10 %)	0,53 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

	Ausschüttende Klasse JPY I ¥	Thesaurierende Klasse USD A US$	Ausschüttende Klasse USD A US$	Thesaurierende Klasse USD B US$	Thesaurierende Klasse USD C2 US$	Thesaurierende Klasse USD E US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	4,82	24,40	15,75	18,10	18,12	15,96
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,01)	(0,28)	(0,18)	(0,41)	(0,43)	(0,36)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	1,13	3,78	2,44	2,78	2,81	2,45
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,12	3,50	2,26	2,37	2,38	2,09
Schlussnettoinventarwert	5,94	27,90	18,01	20,47	20,50	18,05
Gesamtertrag	23,22 %	14,34 %	14,35 %	13,09 %	13,13 %	13,10 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,00 %	1,84 %	1,84 %	2,94 %	2,97 %	2,95 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,21 %)	(1,06 %)	(1,06 %)	(2,14 %)	(2,26 %)	(2,13 %)
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	5,21	30,47	19,67	22,86	22,89	20,15
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,02)	(0,30)	(0,19)	(0,43)	(0,43)	(0,39)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(0,37)	(5,77)	(3,73)	(4,33)	(4,34)	(3,80)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(0,39)	(6,07)	(3,92)	(4,76)	(4,77)	(4,19)
Schlussnettoinventarwert	4,82	24,40	15,75	18,10	18,12	15,96
Gesamtertrag	(7,47 %)	(19,92 %)	(19,93 %)	(20,82 %)	(20,84 %)	(20,79 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,00 %	1,85 %	1,85 %	2,95 %	2,94 %	2,95 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,32 %)	(1,18 %)	(1,16 %)	(2,28 %)	(2,26 %)	(2,29 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD I US$	Ausschüttende Klasse USD I US$	Thesaurierende Klasse USD I3 US$	Thesaurierende Klasse USD M US$	Thesaurierende Klasse USD T US$	Thesaurierende Klasse USD Z US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	27,02	19,66	13.534,58	18,23	19,89	18,32
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,06)	(0,04)	6,71	(0,39)	(0,24)	0,12
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	4,21	3,06	2.106,60	2,79	3,08	2,86
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	4,15	3,02	2.113,31	2,40	2,84	2,98
Schlussnettoinventarwert	31,17	22,68	15.647,89	20,63	22,73	21,30
Gesamtertrag	15,36 %	15,36 %	15,61 %	13,17 %	14,28 %	16,27 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	0,99 %	0,99 %	0,74 %	2,85 %	1,94 %	0,14 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,21 %)	(0,21 %)	0,05 %	(2,04 %)	(1,15 %)	0,63 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	33,46	24,35	16.717,30	22,98	24,87	22,49
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(0,08)	(0,07)	7,33	(0,44)	(0,26)	0,10
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(6,36)	(4,62)	(3.190,05)	(4,31)	(4,72)	(4,27)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(6,44)	(4,69)	(3.182,72)	(4,75)	(4,98)	(4,17)
Schlussnettoinventarwert	27,02	19,66	13.534,58	18,23	19,89	18,32
Gesamtertrag	(19,25 %)	(19,26 %)	(19,04 %)	(20,67 %)	(20,02 %)	(18,54 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen[++]	1,00 %	1,00 %	0,73 %	2,85 %	1,95 %	0,15 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,29 %)	(0,32 %)	0,05 %	(2,28 %)	(1,25 %)	0,54 %

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse ZAR E ZAR	Thesaurierende Klasse ZAR T ZAR
31. Dezember 2023		
Eröffnungsnettoinventarwert	226,59	189,12
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(5,32)	(2,35)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	40,35	33,79
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	35,03	31,44
Schlussnettoinventarwert	261,62	220,56
Gesamtertrag	15,46 %	16,62 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	2,94 %	1,93 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,20 %)	(1,15 %)
31. Dezember 2022		
Eröffnungsnettoinventarwert	279,01	230,55
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:		
Nettoanlageerträge/(-verluste)[+]	(5,60)	(2,62)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten[+]	(46,82)	(38,81)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(52,42)	(41,43)
Schlussnettoinventarwert	226,59	189,12
Gesamtertrag	(18,79 %)	(17,97 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen		
Aufwendungen[++]	3,06 %	2,02 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,36 %)	(1,32 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value

	Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)	Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)*	Thesaurierende Klasse USD A	Thesaurierende Klasse USD I	Thesaurierende Klasse USD I2
	£	£	¥	US$	US$	US$
31. Dezember 2023						
Eröffnungsnettoinventarwert	10,04	9,31	1.000,00	19,11	16,80	8,44
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,01)	0,00	0,62	(0,20)	(0,03)	0,01
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	0,79	0,74	11,91	2,72	2,41	1,21
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	0,78	0,74	12,53	2,52	2,38	1,22
Schlussnettoinventarwert	10,82	10,05	1.012,53	21,63	19,18	9,66
Gesamtertrag	7,77 %	7,95 %	1,25 %	13,19 %	14,17 %	14,45 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	0,98 %	0,81 %	0,75 %	1,85 %	1,00 %	0,83 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,13 %)	0,03 %	0,19 %	(1,01 %)	(0,15 %)	0,06 %
31. Dezember 2022						
Eröffnungsnettoinventarwert	11,24	10,40	–	24,28	21,17	10,00
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:						
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,04)	(0,02)	–	(0,25)	(0,07)	(0,01)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(1,16)	(1,07)	–	(4,92)	(4,30)	(1,55)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(1,20)	(1,09)	–	(5,17)	(4,37)	(1,56)
Schlussnettoinventarwert	10,04	9,31	–	19,11	16,80	8,44
Gesamtertrag	(10,68 %)	(10,48 %)	–	(21,29 %)	(20,64 %)	(15,60 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen						
Aufwendungen++	1,03 %	0,85 %	–	1,85 %	1,00 %	0,83 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(0,37 %)	(0,21 %)	–	(1,25 %)	(0,40 %)	(0,18 %)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

24. FINANZKENNZAHLEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value (Fortsetzung)

	Thesaurierende Klasse USD M US$
31. Dezember 2023	
Eröffnungsnettoinventarwert	15,88
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,34)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	2,25
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	1,91
Schlussnettoinventarwert	17,79
Gesamtertrag	12,03 %
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen++	2,85 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,02 %)
31. Dezember 2022	
Eröffnungsnettoinventarwert	20,38
Erträge aus laufender Geschäftstätigkeit:	
Nettoanlageerträge/(-verluste)+	(0,39)
Realisierter und nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Handelsaktivitäten+	(4,11)
Gesamterträge aus laufender Geschäftstätigkeit	(4,50)
Schlussnettoinventarwert	15,88
Gesamtertrag	(22,08 %)
Verhältnis zum durchschnittlichen Nettovermögen	
Aufwendungen++	2,85 %
Nettoanlageerträge/(-verluste)	(2,25 %)

+ Berechnet auf Basis der durchschnittlichen Anzahl der im Berichtszeitraum im Umlauf befindlichen Anteile.
++ Nach Abzug von etwaigen Kostenverzichten. Die Nettokostenquote enthält sowohl die betrieblichen als auch die nicht betrieblichen Kosten und alle erforderlichen Anpassungen, um die angemessenen Rechnungslegungsstandards zu erfüllen.

Die Kennziffern wurden, wo erforderlich, annualisiert.

* Die Anteilklasse wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt.

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Group LLC, einem bei der SEC in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

Die Teilfonds können Transaktionen in verschiedenen derivativen Instrumenten tätigen, u. a. in Swaptions, Devisenterminkontrakten, Futures-Kontrakten, Differenzkontrakten, umgekehrten Pensionsgeschäften sowie Aktien-, Index- und Währungsoptionskontrakten, Zins-Swaps, Credit Default Swaps, Cross Currency Swaps. Inflation Swaps und Total Return Swaps.

Derivative Kontrakte sind in der Regel Bestandteil der Anlagestrategie der Teilfonds und werden in erster Linie eingesetzt, um Anlagen zu strukturieren und abzusichern, die Performance zu steigern und die Risiken der Teilfonds zu mindern (der Fonds erfasst keine Derivate als Absicherungsinstrumente zwecks Bilanzierung von Sicherungsgeschäften (Hedge Accounting).

Der Fonds setzt derivative Finanzinstrumente ein, um seine Risiken wirtschaftlich abzusichern, und zwar in erster Linie das Zinsrisiko und das Fremdwährungsrisiko. Derivate können auch für Handelszwecke eingesetzt werden, wenn der Manager der Ansicht ist, dass dies effektiver ist als eine direkte Anlage in den zugrundeliegenden Finanzinstrumenten.

Derivate beinhalten bei ihrer Auflegung häufig nur ein wechselseitiges Versprechen, und es findet kein oder nur ein geringer Transfer einer konkreten Gegenleistung statt. Diese Instrumente sind jedoch häufig mit einer hohen Hebelwirkung (Leverage) verbunden und sind sehr volatil. Eine relativ geringfügige Veränderung beim Basiswert eines derivativen Kontrakts kann erhebliche Auswirkungen auf den Gewinn oder Verlust des Fonds haben.

Der Manager überwacht im Rahmen des allgemeinen Portfoliomanagements sorgfältig das Derivaterisiko der Teilfonds.

Der beizulegende Zeitwert dieser derivativen Instrumente wird in der Bilanz ausgewiesen, wobei die Veränderungen im beizulegenden Zeitwert unter dem Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen werden.

Die Teilfonds halten Devisenterminkontrakte, die für währungsgesicherte Anteilklassen spezifisch sind. Wechselkursschwankungen, die diese Devisenterminkontrakte beeinflussen, betreffen nur das Nettovermögen in der entsprechenden Klasse und nicht den Teilfonds als Ganzem. Weitere Informationen zu den Klassen der Devisenterminkontrakte finden Sie in der Aufstellung des Wertpapierbestandes.

Die unten in der Tabelle aufgeführten Nennwerte gelten zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 und geben einen Hinweis auf das Volumen der Derivate-Aktivitäten für das Jahr/den Zeitraum. Die Nennwerte geben keinen Hinweis auf das Markt- oder Kreditrisiko.

		31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
Devisenterminkontrakte	**Währung**	**Nennwert**	**Nennwert**
5G Connectivity	USD	236.536.022	315.672.850
China Bond	CNY	536.589.074	466.298.618
China Equity	USD	28.710.020	30.491.380
CLO Income	USD	130.534.080	76.412.170
Commodities[1]	USD	54.148.553	34.220.208
Corporate Hybrid Bond	EUR	1.118.180.142	1.362.463.245
Developed Market FMP – 2027[2]	USD	1.133.780	-
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	2.657.772.120	1.673.599.864
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	1.214.708.531	1.436.786.755
Emerging Market Debt Blend	USD	504.440.886	403.481.714
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	100.020.133	59.461.234
Emerging Markets Equity	USD	54.678.419	41.179.268
Euro Bond Absolute Return	EUR	35.245.823	30.393.822
European High Yield Bond	EUR	108.348.724	65.179.427
Event Driven[1]	USD	132.172.668	29.205.089
Global Bond	USD	150.986.080	98.358.364

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
Global Diversified Income FMP – 2024	USD	9.203.545	9.331.213
Global Equity Megatrends	USD	30.481	-
Global Flexible Credit Income	USD	331.943.470	705.321.007
Global SDG Engagement	USD	474.540.027	349.524.039
Global High Yield Sustainable Action*	USD	-	5.642.133
Global Investment Grade Credit	USD	26.767.826	24.960.937
Global Opportunistic Bond	USD	235.063.065	121.647.472
Global Real Estate Securities	USD	23.138.464	17.342.893
Global Sustainable Value	USD	3.119.371	3.128.584
High Yield Bond	USD	1.489.865.792	1.349.607.844
InnovAsia 5G	USD	10.478.005	9.698.871
Japan Equity Engagement	JPY	21.518.936.255	13.127.966.057
Macro Opportunities FX	EUR	182.961.855	219.491.178
Multi-Asset Income**	USD	-	14.560.479
Next Generation Mobility	USD	975.096	7.949.517
Responsible Asian Debt – Hard Currency	USD	11.722.267	3.526.442
Short Duration Emerging Market Debt	USD	4.010.880.484	4.086.532.395
Short Duration High Yield SDG Engagement	USD	492.272.559	400.764.403
Strategic Income	USD	867.654.333	566.633.760
Sustainable Asia High Yield	USD	502.471	5.021.605
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	96.562.462	84.435.953
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[1]	USD	929.547.617	145.143.252
Tactical Macro[2]	USD	9.452.752	-
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	78.865.876	99.908.396
Uncorrelated Strategies	USD	5.737.835.188	6.286.016.234
Uncorrelated Trading[1]***	USD	-	1.330.232.992
US Equity	USD	34.549.253	36.487.253
US Equity Index PutWrite	USD	355.813.860	316.156.345
US Large Cap Value	USD	37.851.694	20.699.861
US Long Short Equity	USD	105.191.194	115.952.786
US Multi Cap Opportunities	USD	61.796.292	68.451.167
US Real Estate Securities	USD	78.345.359	124.004.185
US Small Cap	USD	24.099.492	23.068.007
US Small Cap Intrinsic Value	USD	70.545	-

Umgekehrte Pensionsgeschäfte	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
Corporate Hybrid Bond	EUR	-	37.445.575
Short Duration Emerging Market Debt	USD	-	1.843.240

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Differenzkontrakte****	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
Uncorrelated Strategies	USD	18.527.858.864	16.075.343.237
Uncorrelated Trading[1]***	USD	-	5.349.743.324
US Long Short Equity	USD	28.973.543	1.729.270

Optionskontrakte****	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
Multi-Asset Income**	USD	-	20.339.500
Tactical Macro[2]	USD	85.104.250	-
Uncorrelated Strategies	USD	244.630.695.031	764.870.377.121
Uncorrelated Trading[1]***	USD	-	116.969.966.645
US Equity Index PutWrite	USD	866.681.500	674.205.500
US Long Short Equity	USD	291.000	3.949.500

Futures-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
China Bond	CNY	26.505.043	38.886.099
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	986.812.165	822.237.099
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	84.527.494	42.455.404
Emerging Market Debt Blend	USD	51.881.592	35.414.447
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	24.159.242	18.036.421
Euro Bond	EUR	3.513.575	3.271.870
Euro Bond Absolute Return	EUR	15.781.567	35.660.318
Global Bond	USD	33.535.327	35.754.749
Global Flexible Credit Income	USD	260.557.739	162.501.298
Global Opportunistic Bond	USD	47.022.109	51.243.234
Multi-Asset Income**	USD	-	869.685
Responsible Asian Debt - Hard Currency	USD	8.954.742	3.925.584
Strategic Income	USD	654.727.669	474.617.087
Sustainable Asia High Yield[2]	USD	1.991.269	937.591
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	USD	7.050.009	7.688.938
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[1]	USD	297.536.001	64.369.018
Tactical Macro[2]	USD	2.715.279	-
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	251.012.145	327.521.420
Uncorrelated Strategies	USD	9.724.843.403	9.826.365.666
Uncorrelated Trading[1]***	USD	-	2.525.719.173
US Long Short Equity	USD	31.749.852	13.179.449

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Zinsswap-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
Emerging Market Debt - Local Currency	USD	656.595.371	821.752.427
Emerging Market Debt Blend	USD	166.413.907	203.755.855
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	USD	4.004.768	3.716.607
Euro Bond	EUR	370.031	798.031
Euro Bond Absolute Return	EUR	3.700.000	2.700.000
Global Bond	USD	9.036.298	7.904.541
Global Opportunistic Bond	USD	3.933.342	11.239.246
Responsible Asian Debt - Hard Currency	USD	2.177.818	-
Strategic Income	USD	41.520.219	22.490.454
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	12.479.054	62.479.054
Uncorrelated Strategies	USD	7.325.096.477	44.778.595.660
Uncorrelated Trading[1]***	USD	-	7.934.771.768

Credit-Default-Swap-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
Emerging Market Debt - Hard Currency	USD	-	32.640.000
Emerging Market Debt Blend	USD	-	28.350.680
Euro Bond	EUR	680.000	600.000
Euro Bond Absolute Return	EUR	2.260.000	3.000.000
Global Bond	USD	3.720.000	2.972.291
Global Opportunistic Bond	USD	15.969.000	13.727.919
Strategic Income	USD	15.523.200	13.175.213
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[1]	USD	-	920.000
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	27.200.000	50.000.000
Uncorrelated Strategies	USD	79.163.211	61.521.538
Uncorrelated Trading[1]***	USD	-	4.323.083

Total Return Swap-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
CLO Income	USD	4.999.582	13.500.000
Commodities[1]	USD	152.007.385	84.753.608
European High Yield Bond	EUR	10.018.326	-
Event Driven[1]	USD	103.060.180	38.432.156
Global Flexible Credit Income	USD	28.497.618	25.001.730
Global SDG Engagement	USD	-	37.950.000
High Yield Bond	USD	25.000.000	16.000.000
Strategic Income	USD	73.680.000	126.680.000
Uncorrelated Strategies	USD	212.596.112	297.054.845
Uncorrelated Trading[1]***	USD	-	8.674.407
US Long Short Equity	USD	17.801.276	34.605.119

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Swaptions	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
Strategic Income	USD	22.093.100	-
Uncorrelated Strategies	USD	1.159.882.479	1.632.559.980
Uncorrelated Trading[1]***	USD	-	256.139.995

Inflation Swap-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
Euro Bond	EUR	750.000	250.000
Euro Bond Absolute Return	EUR	3.000.000	10.997.950
Ultra Short Term Euro Bond	EUR	60.000.000	25.000.000
Uncorrelated Strategies	USD	-	623.548.271

Volatility-Swap-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
Uncorrelated Strategies	USD	10.275.687.487	8.644.681.560
Uncorrelated Trading[1]***	USD	-	470.373.765

Variance-Swap-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
Uncorrelated Strategies	USD	7.442.979	2.793.362
Uncorrelated Trading[1]***	USD	-	1.413.362

Correlation-Swap-Kontrakte****	Währung	31. Dezember 2023 Nennwert	31. Dezember 2022 Nennwert
Uncorrelated Strategies	USD	5.000.000	13.270.000
Uncorrelated Trading[1]***	USD	-	1.000.000

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.
** Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.
*** Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.
**** Die angezeigten Beträge sind absolute Nennwerte.

[1] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.
[2] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Der realisierte Nettogewinn/(-verlust) und die Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 sowie die Beträge, die im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten innerhalb der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst wurden, sind wie folgt (Beträge in der jeweiligen Basiswährung der Portfolios):

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
5G Connectivity								
Devisenterminkontrakte	5.192.363	(3.552.805)	-	-	-	-	-	-
China Bond								
Devisenterminkontrakte	13.714.698	(1.637.908)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(3.254.641)	641.419	-	-	-	-
China Equity								
Devisenterminkontrakte	184.079	(158.273)	-	-	-	-	-	-
CLO Income								
Devisenterminkontrakte	3.533.994	(2.503.040)	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	314.738	383.055
Commodities[1]								
Devisenterminkontrakte	1.062.795	176.812	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	(13.495.759)	-	-	-
Corporate Hybrid Bond								
Devisenterminkontrakte	(2.362.877)	(11.919.193)	-	-	-	-	-	-
Developed Market FMP – 2027[2]								
Devisenterminkontrakte	(25.249)	39.476	-	-	-	-	-	-
Emerging Market Debt - Hard Currency								
Devisenterminkontrakte	(10.104.061)	17.367.203	-	-	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)								
Futures-Kontrakte	-	-	(12.892.426)	(12.494.331)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	904.188	(1.909.636)
Emerging Market Debt - Local Currency								
Devisenterminkontrakte	11.460.818	(487.320)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	197.184	273.385	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(34.175.882)	34.762.871	-	-	-	-
Emerging Market Debt Blend								
Devisenterminkontrakte	2.131.413	2.590.338	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(1.123.477)	(786.259)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(3.699.073)	3.557.307	-	-	(1.408.426)	(1.658.685)
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend								
Devisenterminkontrakte	(3.206.578)	1.934.611	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(886.171)	(68.929)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(94.090)	73.032	-	-	-	-
Emerging Markets Equity								
Devisenterminkontrakte	(2.109)	98.303	-	-	-	-	-	-
Euro Bond								
Futures-Kontrakte	-	-	(14.161)	53.871	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	1.073	27.954	-	-	(31.470)	(47.958)
Euro Bond Absolute Return								
Devisenterminkontrakte	(357.013)	(100.045)	-	-	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)								
Futures-Kontrakte	-	-	1.146.748	(1.649.016)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	40.607	162.305	-	-	(147.516)	(148.450)
European High Yield Bond								
Devisenterminkontrakte	(1.982.496)	1.216.114	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(9.760)	18.355
Event Driven[1]								
Devisenterminkontrakte	206.153	3.003.125	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	1.227.916	941.165
Global Bond								
Devisenterminkontrakte	(1.032.207)	(588.150)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	340.673	(261.309)	-	-	-	-
Optionskontrakte	-	-	(14.000)	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	221.533	123.475	-	-	3.562	(59.106)
Global Diversified Income FMP–2024								
Devisenterminkontrakte	410.477	(241.838)	-	-	-	-	-	-
Global Equity Megatrends								
Devisenterminkontrakte	-	444	-	-	-	-	-	-
Global Flexible Credit Income								
Devisenterminkontrakte	23.332.772	(13.492.432)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	2.424.244	(1.391.731)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	249.754	900.363

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Global SDG Engagement								
Devisenterminkontrakte	2.790.595	1.750.164	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	301.493	(13.411)
Global High Yield Sustainable Action*								
Devisenterminkontrakte	(430.114)	350.409	-	-	-	-	-	-
Global Investment Grade Credit								
Devisenterminkontrakte	(1.050.604)	520.360	-	-	-	-	-	-
Global Opportunistic Bond								
Devisenterminkontrakte	(1.960.311)	883.559	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(646.937)	521.019	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(71.440)	(17.226)	-	-	(1.285.179)	(1.018.186)
Global Real Estate Securities								
Devisenterminkontrakte	448.253	(546.458)	-	-	-	-	-	-
Global Sustainable Value								
Devisenterminkontrakte	20.982	(15.305)	-	-	-	-	-	-
High Yield Bond								
Devisenterminkontrakte	12.174.201	(5.197.021)	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	240.943	353.035
InnovAsia 5G								
Devisenterminkontrakte	212.374	(135.608)	-	-	-	-	-	-
Japan Equity Engagement								
Devisenterminkontrakte	1.239.623.973	183.165.732	-	-	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Macro Opportunities FX								
Devisenterminkontrakte	(2.127.786)	824.969	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	8.828	-	-	-	-	-
Multi-Asset Income*								
Devisenterminkontrakte	(540.982)	423.900	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	4.128	(40.257)	(2.851)	(7.781)	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	226.839	55.510	-	-
Next Generation Mobility								
Devisenterminkontrakte	65.632	(70.243)	-	-	-	-	-	-
Responsible Asian Debt - Hard Currency								
Devisenterminkontrakte	(84.287)	42.076	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	246.941	84.106	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	17.942	554	-	-	(1.774)	-
Short Duration Emerging Market Debt								
Devisenterminkontrakte	(41.340.360)	32.707.080	-	-	-	-	-	-
Short Duration High Yield SDG Engagement								
Devisenterminkontrakte	(8.357.412)	(5.584.858)	-	-	-	-	-	-
Strategic Income								
Devisenterminkontrakte	(14.302.284)	(7.621.460)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	24.458.245	(16.418.065)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(55.651)	214.167	-	-	8.912.186	5.302.649
Swaptions	-	-	-	-	-	-	(1.003)	15.122

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Sustainable Asia High Yield								
Devisenterminkontrakte	309.753	(236.678)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	52.309	(47.496)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(1.885)	-
Sustainable Emerging Market Corporate Debt								
Devisenterminkontrakte	580.387	951.841	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	404.614	(251.450)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(21.639)	-
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[1]								
Devisenterminkontrakte	(8.837.398)	6.354.956	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(8.439.258)	1.469.059	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(129.166)	(53.826)
Tactical Macro[2]								
Devisenterminkontrakte	(15.490)	30.520	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	88.726	(19.364)	-	-	-	-
Optionskontrakte	35.570	(80.493)	35.286	(4.131)	7.969	(22.675)	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(17.694)	-	20.220	-	-	-
Ultra Short Term Euro Bond								
Devisenterminkontrakte	(5.209.978)	4.062.314	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	6.652.152	(9.957.859)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(104.982)	1.716.421	-	-	(1.827.198)	(1.635.504)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Uncorrelated Strategies								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	(38.284.984)	66.830.536	-	-
Devisenterminkontrakte	194.838.411	(135.694.188)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	(12.511)	(465.602)	(57.783.403)	(23.399.970)	(214.065)	2.337.191	-	-
Optionskontrakte	(5.650.286)	(977.722)	(45.886.349)	21.433.917	(91.796.907)	(8.714.110)	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	30.631.005	(47.398.570)	(18.554.766)	(18.067.170)	(812.024)	(1.430.223)
Swaptions	-	-	-	-	-	-	(8.831.969)	(669.209)
Uncorrelated Trading[1]*								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	86.773.401	(10.664.847)	-	-
Devisenterminkontrakte	47.134.508	(48.168.205)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	(267.113)	(85.165.159)	(3.388.046)	-	55.918	-	-
Optionskontrakte	18.261	(31.049)	932.386	(5.901.762)	(16.637.386)	12.495.011	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	782.103	(23.822)	(4.798.143)	(1.055.312)	(317.578)	47.926
Swaptions	-	-	-	-	-	-	(162.308)	(48.110)
US Equity								
Devisenterminkontrakte	(2.356.287)	(476.620)	-	-	-	-	-	-
US Equity Index PutWrite								
Devisenterminkontrakte	17.968.715	(3.650.755)	-	-	-	-	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	69.891.783	7.680.530	-	-
US Large Cap Value								
Devisenterminkontrakte	213.781	132.060	-	-	-	-	-	-
US Long Short Equity								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	(374.469)	(3.986.584)	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
US Long Short Equity (Fortsetzung)								
Devisenterminkontrakte	3.889.440	(2.923.219)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-			(4.880.547)	(1.473.682)	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	405.975	58.646	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	(641.328)	(4.599.498)	-	-
US Multi Cap Opportunities								
Devisenterminkontrakte	225.651	(630.018)	-	-	-	-	-	-
US Real Estate Securities								
Devisenterminkontrakte	(421.811)	(942.444)	-	-	-	-	-	-
US Small Cap								
Devisenterminkontrakte	(13.823)	(102.532)	-	-	-	-	-	-
US Small Cap Intrinsic Value								
Devisenterminkontrakte	-	(398)	-	-	-	-	-	-

Der realisierte Nettogewinn/(-verlust) und die Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 sowie die Beträge, die im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten innerhalb der Gewinn- und Verlustrechnung erfasst wurden, sind wie folgt (Beträge in der jeweiligen Basiswährung der Portfolios):

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
5G Connectivity								
Devisenterminkontrakte	(34.344.868)	13.655.498	-	-	-	-	-	-
Absolute Return Multi Strategy*								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	(7.199)	11.507	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
China Bond								
Devisenterminkontrakte	21.788.314	1.834.914	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	397.557	376.843	-	-	-	-
China Equity								
Devisenterminkontrakte	(861.539)	353.434	-	-	-	-	-	-
CLO Income								
Devisenterminkontrakte	(9.039.612)	2.915.180	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(1.114.339)	(426.769)
Commodities[1]								
Devisenterminkontrakte	(1.341.444)	1.186.450	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(2.192.655)	-
Corporate Hybrid Bond								
Devisenterminkontrakte	(15.809.097)	18.274.199	-	-	-	-	-	-
Emerging Market Debt - Hard Currency								
Devisenterminkontrakte	(78.939.684)	(8.691.729)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	628.973	8.154.605	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(7.765.872)	1.909.636
Emerging Market Debt - Local Currency								
Devisenterminkontrakte	8.599.439	(3.428.586)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	3.755.166	(520.080)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(88.998.948)	1.486.967	-	-	-	-
Emerging Market Debt Blend								
Devisenterminkontrakte	(22.804.911)	(1.661.584)	-	-	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)								
Futures-Kontrakte	-	-	4.186.757	(381.781)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(19.525.431)	1.960.832	-	-	(1.050.415)	1.658.685
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend								
Devisenterminkontrakte	(1.082.921)	(403.699)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(286.000)	295.644	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(390.025)	51.099	-	-	7.490	-
Emerging Markets Equity								
Devisenterminkontrakte	(1.957.650)	597.444	-	-	-	-	-	-
Euro Bond								
Futures-Kontrakte	-	-	108.706	(65.437)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	63.482	(44.999)	-	-	50.723	99.719
Euro Bond Absolute Return								
Devisenterminkontrakte	2.236.954	(1.200.201)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	3.543.656	981.478	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	779.826	(206.284)	-	-	260.191	439.571
European High Yield Bond								
Devisenterminkontrakte	5.167.949	(2.310.995)	-	-	-	-	-	-
Event Driven[1]								
Devisenterminkontrakte	(13.858)	899.453	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	313.692	18.364

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Global Bond								
Devisenterminkontrakte	(2.361.521)	400.741	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	609.985	431.813	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	428.391	23.192	-	-	150.351	(90.970)
Global Diversified Income FMP–2024								
Devisenterminkontrakte	(1.113.567)	576.942	-	-	-	-	-	-
Global Equity Megatrends								
Devisenterminkontrakte	(18)	-	-	-	-	-	-	-
Global Flexible Credit Income								
Devisenterminkontrakte	(68.588.731)	19.348.780	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	33.526.553	2.325.216	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(4.875.341)	(1.434.469)
Swaptions	-	-	-	-	-	-	80.560	4.894
Global SDG Engagement								
Devisenterminkontrakte	(6.766.315)	3.781.363	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(4.592)	13.411
Global High Yield Sustainable Action								
Devisenterminkontrakte	778.395	(409.366)	-	-	-	-	-	-
Global Investment Grade Credit								
Devisenterminkontrakte	4.793.821	(2.081.880)	-	-	-	-	-	-
Global Opportunistic Bond								
Devisenterminkontrakte	6.821.249	(3.237.790)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(1.155.660)	74.259	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)								
Swap-Kontrakte	-	-	(758)	30.702	-	-	835.892	2.024.541
Global Real Estate Securities								
Devisenterminkontrakte	(2.134.514)	906.198	-	-	-	-	-	-
Global Sustainable Equity								
Devisenterminkontrakte	13	-	-	-	-	-	-	-
Global Sustainable Value								
Devisenterminkontrakte	(105.940)	45.453	-	-	-	-	-	-
High Yield Bond								
Devisenterminkontrakte	(74.656.641)	50.120.907	-	-	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(238.629)	(1.063.058)
InnovAsia 5G								
Devisenterminkontrakte	(1.110.501)	484.488	-	-	-	-	-	-
Japan Equity Engagement								
Devisenterminkontrakte	681.276.741	(97.210.699)	-	-	-	-	-	-
Macro Opportunities FX								
Devisenterminkontrakte	(1.503.902)	(18.792)	-	-	-	-	-	-
Multi-Asset Income								
Devisenterminkontrakte	916.535	(482.244)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	198.584	33.623	(9.147)	7.781	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	(468.909)	(38.953)	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	194	(2.121)	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Next Generation Mobility								
Devisenterminkontrakte	(808.298)	179.277	-	-	-	-	-	-
Responsible Asian Debt - Hard Currency								
Devisenterminkontrakte	95.145	(53.507)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	227.141	52.911	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	3.333	(4.908)	-	-	-	-
Short Duration Emerging Market Debt								
Devisenterminkontrakte	(403.920.805)	19.021.418	-	-	-	-	-	-
Short Duration High Yield SDG Engagement								
Devisenterminkontrakte	(55.455.517)	21.866.711	-	-	-	-	-	-
Strategic Income								
Devisenterminkontrakte	(74.954.126)	24.788.769	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	53.107.795	5.375.960	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(540.221)	(243.829)	-	-	(9.575.369)	(6.211.370)
Sustainable Asia High Yield								
Devisenterminkontrakte	(3.848.434)	253.108	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	264.520	10.935	-	-	-	-
Sustainable Emerging Market Corporate Debt								
Devisenterminkontrakte	(6.903.324)	262.510	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	2.013.756	(46.228)	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(385)	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[1]								
Devisenterminkontrakte	(3.200.125)	375.279	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	(884.014)	2.466.299	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	-	-	(258.198)	53.826
Ultra Short Term Euro Bond								
Devisenterminkontrakte	15.556.930	(7.308.456)	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	21.706.368	4.200.214	-	-	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	2.573.798	(2.325.045)	-	-	2.234.039	3.351.766
Uncorrelated Strategies								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	(75.358.014)	(12.335.649)	-	-
Devisenterminkontrakte	(395.704.157)	191.661.278	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	65.592.148	1.797.289	289.296.178	32.243.865	25.921.705	(1.228.836)	-	-
Optionskontrakte	(4.841.697)	(89.564)	(47.455.691)	13.905.598	(10.770.042)	(6.431.124)	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(34.100.737)	44.421.655	(6.250.384)	32.687.227	429.240	1.030.699
Swaptions	-	-	-	-	-	-	(2.826.480)	337.180
Uncorrelated Trading[1]								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	(86.214.611)	10.664.847	-	-
Devisenterminkontrakte	(49.448.101)	48.168.205	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	(4.908.877)	267.113	92.877.614	3.388.046	3.487.382	(55.918)	-	-
Optionskontrakte	2.464	31.049	(5.203.204)	5.862.351	(3.718.815)	(12.495.011)	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	(16.847)	23.822	(957.745)	1.055.312	220.296	(47.926)
Swaptions	-	-	-	-	-	-	(779.292)	48.110

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
US Equity								
Devisenterminkontrakte	(2.263.323)	1.611.149	-	-	-	-	-	-
US Equity Index PutWrite								
Devisenterminkontrakte	(39.013.051)	14.321.515	-	-	-	-	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	(51.698.219)	(9.262.537)	-	-
US Large Cap Value								
Devisenterminkontrakte	(551.371)	871.125	-	-	-	-	-	-
US Long Short Equity								
Differenzkontrakte	-	-	-	-	9.575.763	2.406.289	-	-
Devisenterminkontrakte	(20.069.073)	9.726.320	-	-	-	-	-	-
Futures-Kontrakte	-	-	252.059	234	9.712.450	1.232.318	-	-
Optionskontrakte	-	-	-	-	48.013	(68.616)	-	-
Swap-Kontrakte	-	-	-	-	(1.409.044)	12.988.292	-	-
US Multi Cap Opportunities								
Devisenterminkontrakte	(4.218.776)	2.763.511	-	-	-	-	-	-
US Real Estate Securities								
Devisenterminkontrakte	(12.175.067)	5.848.700	-	-	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

	Wechselkursrisiko		Zinsrisiko		Eigenkapitalrisiko		Kreditrisiko	
	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)	Realisierter Nettogewinn/ (-verlust)	Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts)
US Small Cap								
Devisenterminkontrakte	(3.061.212)	1.174.184	-	-	-	-	-	-
US Small Cap Intrinsic Value								
Devisenterminkontrakte	1.730	-	-	-	-	-	-	-

* Der Teilfonds wurde während des aktuellen oder vorherigen Berichtsjahres aufgelöst.

[1] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.
[2] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

25. DERIVATIVE KONTRAKTE (FORTSETZUNG)

Bedingte Merkmale in Bezug auf das Kreditrisiko

Die derivativen Kontrakte der Teilfonds unterliegen dem International Swaps and Derivatives Association Master Agreement (ISDA), das bestimmte Verpflichtungen und andere Bestimmungen enthält, wonach der Fonds möglicherweise zusätzliche Sicherheiten für Derivate stellen oder diese Kontrakte kündigen muss, wenn der Fonds nicht über eine ausreichende Anlagedeckung (Asset Coverage) für seine Kontrakte verfügt oder sein Nettovermögen um einen festgelegten Prozentsatz oder Betrag sinkt. Die Teilfonds gingen im Rahmen ihrer Anlagestrategien Credit Default Swaps ein, um sich gegen nachteilige Veränderungen im Wert von Anlagen abzusichern und sich vor nachteiligen Änderungen der Zinssätze oder der Kreditperformance von Gegenparteien zu schützen. Der maximale potenzielle Betrag, den die Teilfonds als Verkäufer eines Kreditschutzes eventuell zahlen müssen, wenn ein Kreditereignis eintritt, belief sich zum 31. Dezember 2023 auf 127.047.007 US$ (31. Dezember 2022: 120.546.104 US$). Die Summe des Zeitwerts aller Credit Default Swaps in Nettovermögensposition betrug zum 31. Dezember 2023 (3.082.098) US$ (31. Dezember 2022: (4.166.005) US$ Der Fonds hielt zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 keine derivativen Instrumente mit bedingten Merkmalen in Bezug auf das Kreditrisiko.

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN

Der Manager des Fonds ist ein verbundenes Unternehmen von Neuberger Berman Group LLC, einem bei der SEC in den USA registrierten Anlageberater. Die hierin enthaltenen Informationen spiegeln die den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen der USA entsprechenden Offenlegungen wider, so dass der Manager von bestimmten Ausnahmen Gebrauch machen kann, die ihm gemäß SEC Custody Rule zur Verfügung stehen.

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden nur dann saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, wenn ein Rechtsanspruch besteht, die erfassten Beträge miteinander zu verrechnen und beabsichtigt wird, entweder den Ausgleich auf Nettobasis herbeizuführen oder gleichzeitig mit der Verwertung der betreffenden Vermögenswerte die dazugehörigen Verbindlichkeiten abzulösen.

Im Rahmen der finanziellen Berichterstattung nimmt der Fonds keine Saldierung von derivativen Vermögenswerten und derivativen Verbindlichkeiten in der Bilanz vor. Die folgenden Tabellen zeigen die außerbörslichen Derivategeschäfte (OTC-Derivate), Vermögenswerte aus Wertpapierleihgeschäften und Verbindlichkeiten des Fonds nach Gegenparteien, abzüglich von Beträgen, die im Rahmen eines Master Netting Agreements für eine Saldierung verfügbar sind, und abzüglich der zugehörigen Sicherheiten, die der Fonds zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 für Vermögenswerte erhalten hat und vom Fonds für Verbindlichkeiten hinterlegt wurden.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	6.342.222	(1.033.321)
Insgesamt	6.342.222	(1.033.321)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
BNP Paribas	-	-	-	-	(58)	-	-	(58)
Goldman Sachs International	370.835	(215.169)	-	155.666	(215.169)	215.169	-	-
Standard Chartered Bank	16.571	(16.571)	-	-	(85.735)	16.571	-	(69.164)
State Street Bank and Trust Co	40.673	(40.673)	-	-	(63.143)	40.673	-	(22.470)
UBS AG	3.896.298	(69.056)	-	3.827.242	(69.056)	69.056	-	-
Westpac Banking Corp	2.017.845	(600.160)	-	1.417.685	(600.160)	600.160	-	-
Insgesamt	6.342.222	(941.629)	-	5.400.593	(1.033.321)	941.629	-	(91.692)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

5G Connectivity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	12.141.765	(3.280.059)
Insgesamt	12.141.765	(3.280.059)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	541.183	(312.602)	-	228.581	(312.602)	312.602	-	-
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	(63.294)	-	-	(63.294)
State Street Bank and Trust Co	165.112	(165.112)	-	-	(610.428)	165.112	-	(445.316)
UBS AG	148.500	(148.500)	-	-	(315.586)	148.500	-	(167.086)
Westpac Banking Corp	11.286.970	(1.978.149)	-	9.308.821	(1.978.149)	1.978.149	-	-
Insgesamt	12.141.765	(2.604.363)	-	9.537.402	(3.280.059)	2.604.363	-	(675.696)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Bond

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte CNY	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten CNY
Devisenterminkontrakte	1.943.751	(2.361.945)
Insgesamt	1.943.751	(2.361.945)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten CNY	Erhaltene Sicher-heiten(a) CNY	Nettobetrag(b) CNY	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte CNY	Verpfändete Sicherheiten(a) CNY	Nettobetrag(b) CNY
Citibank NA	1.917.777	(333.720)	-	1.584.057	(333.720)	333.720	-	-
JPMorgan Chase Bank	1.318	(56)	-	1.262	(56)	56	-	-
Standard Chartered Bank	24.656	(24.656)	-	-	(209.677)	24.656	-	(185.021)
UBS AG	-	-	-	-	(1.818.492)	-	-	(1.818.492)
Insgesamt	1.943.751	(358.432)	-	1.585.319	(2.361.945)	358.432	-	(2.003.513)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte CNY	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten CNY
Devisenterminkontrakte	3.921.557	(2.701.843)
Insgesamt	3.921.557	(2.701.843)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten CNY	Erhaltene Sicherheiten[a] CNY	Nettobetrag[b] CNY	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge CNY	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte CNY	Verpfändete Sicherheiten[a] CNY	Nettobetrag[b] CNY
Citibank NA	68.042	(68.042)	-	-	(156.782)	68.042	-	(88.740)
Goldman Sachs International	1.680.891	-	-	1.680.891	-	-	-	-
JPMorgan Chase Bank	-	-	-	-	(2.520.269)	-	-	(2.520.269)
Standard Chartered Bank	1.992.935	-	-	1.992.935	-	-	-	-
UBS AG	162.642	(24.648)	-	137.994	(24.648)	24.648	-	-
Westpac Banking Corp	17.047	(144)	-	16.903	(144)	144	-	-
Insgesamt	3.921.557	(92.834)	-	3.828.723	(2.701.843)	92.834	-	(2.609.009)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Equity

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	547.220	(423.344)
Insgesamt	547.220	(423.344)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicher-heiten(a) US$	Nettobetrag(b) US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten(a) US$	Nettobetrag(b) US$
Goldman Sachs International	185.443	(149.854)	-	35.589	(149.854)	149.854	-	-
UBS AG	166.978	(129.390)	-	37.588	(129.390)	129.390	-	-
Westpac Banking Corp	194.799	(144.100)	-	50.699	(144.100)	144.100	-	-
Insgesamt	547.220	(423.344)	-	123.876	(423.344)	423.344	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

China Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	1.099.861	(817.712)
Insgesamt	1.099.861	(817.712)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	16.443	(16.443)	-	-	(20.824)	16.443	-	(4.381)
UBS AG	3.274	(3.274)	-	-	(22.277)	3.274	-	(19.003)
Westpac Banking Corp	1.080.144	(774.611)	-	305.533	(774.611)	774.611	-	-
Insgesamt	1.099.861	(794.328)	-	305.533	(817.712)	794.328	-	(23.384)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

CLO Income

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	2.345.289	(2.570.754)
OTC-Kontrakt	48.732	-
Insgesamt	2.394.021	(2.570.754)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	175.123	(7.243)	-	167.880	(7.243)	7.243	-	-
State Street Bank and Trust Co	337.885	(337.885)	-	-	(1.885.494)	337.885	-	(1.547.609)
UBS AG	353.824	(343.797)	-	10.027	(343.797)	343.797	-	-
Westpac Banking Corp	1.527.189	(334.220)	-	1.192.969	(334.220)	334.220	-	-
Insgesamt	2.394.021	(1.023.145)	-	1.370.876	(2.570.754)	1.023.145	-	(1.547.609)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	3.267.421	(989.846)
OTC-Kontrakt	-	(334.323)
Insgesamt	3.267.421	(1.324.169)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	16.221	(16.221)	-	-	(334.558)	16.221	318.337	-
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(760.209)	-	-	(760.209)
UBS AG	1.109.111	-	-	1.109.111	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	2.142.089	(229.402)	-	1.912.687	(229.402)	229.402	-	-
Insgesamt	3.267.421	(245.623)	-	3.021.798	(1.324.169)	245.623	318.337	(760.209)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Commodities[2]

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	1.573.388	(210.126)
Insgesamt	1.573.388	(210.126)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Standard Chartered Bank	1.405.179	(54.235)	-	1.350.944	(54.235)	54.235	-	-
State Street Bank and Trust Co	42.435	(14.392)	-	28.043	(14.392)	14.392	-	-
Westpac Banking Corp	125.774	(125.774)	-	-	(141.499)	125.774	-	(15.725)
Insgesamt	1.573.388	(194.401)	-	1.378.987	(210.126)	194.401	-	(15.725)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Commodities[2] (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	1.519.496	(333.046)
Insgesamt	1.519.496	(333.046)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Standard Chartered Bank	1.312.734	(19.921)	-	1.292.813	(19.921)	19.921	-	-
State Street Bank and Trust Co	23.465	(23.465)	-	-	(75.175)	23.465	-	(51.710)
Westpac Banking Corp	183.297	(183.297)	-	-	(237.950)	183.297	-	(54.653)
Insgesamt	1.519.496	(226.683)	-	1.292.813	(333.046)	226.683	-	(106.363)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte EUR	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten EUR
Devisenterminkontrakte	12.101.176	(7.732.130)
Insgesamt	12.101.176	(7.732.130)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten[(a)] EUR	Nettobetrag[(b)] EUR	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten[(a)] EUR	Nettobetrag[(b)] EUR
Goldman Sachs International	360.537	(360.537)	-	-	(659.450)	360.537	-	(298.913)
UBS AG	601.277	(601.277)	-	-	(6.754.447)	601.277	-	(6.153.170)
Westpac Banking Corp	11.139.362	(318.233)	-	10.821.129	(318.233)	318.233	-	-
Insgesamt	12.101.176	(1.280.047)	-	10.821.129	(7.732.130)	1.280.047	-	(6.452.083)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte EUR	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten EUR
Devisenterminkontrakte	36.511.573	(20.223.334)
Insgesamt	36.511.573	(20.223.334)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR
Goldman Sachs International	944.612	(775.751)	-	168.861	(775.751)	775.751	-	-
UBS AG	3.550.212	(686.746)	-	2.863.466	(686.746)	686.746	-	-
Westpac Banking Corp	32.016.749	(18.760.837)	-	13.255.912	(18.760.837)	18.760.837	-	-
Insgesamt	36.511.573	(20.223.334)	-	16.288.239	(20.223.334)	20.223.334	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Developed Market FMP – 20271

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	39.869	(393)
Insgesamt	39.869	(393)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Goldman Sachs International	145	(145)	-	-	(372)	145	-	(227)
State Street Bank and Trust Co	20.072	-	-	20.072	-	-	-	-
UBS AG	19.624	(21)	-	19.603	(21)	21	-	-
Westpac Banking Corp	28	-	-	28	-	-	-	-
Insgesamt	39.869	(166)	-	39.703	(393)	166	-	(227)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	24.839.124	(5.652.118)
Insgesamt	24.839.124	(5.652.118)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Citibank NA	261.317	(261.317)	-	-	(322.041)	261.317	-	(60.724)
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	(140.358)	-	-	(140.358)
Goldman Sachs International	572.854	(14.397)	-	558.457	(14.397)	14.397	-	-
HSBC Bank Plc	-	-	-	-	(4.877.290)	-	4.877.290	-
UBS AG	20.827.597	(1.415)	-	20.826.182	(1.415)	1.415	-	-
Westpac Banking Corp	3.177.356	(296.617)	-	2.880.739	(296.617)	296.617	-	-
Insgesamt	24.839.124	(573.746)	-	24.265.378	(5.652.118)	573.746	4.877.290	(201.082)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	12.379.899	(10.560.096)
Insgesamt	12.379.899	(10.560.096)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Brown Brothers Harriman	-	-	-	-	(35.687)	-	-	(35.687)
Goldman Sachs International	89.565	(89.565)	-	-	(765.905)	89.565	-	(676.340)
HSBC Bank Plc	-	-	-	-	(109.096)	-	-	(109.096)
UBS AG	9.726.057	(8.242.559)	-	1.483.498	(8.242.559)	8.242.559	-	-
Westpac Banking Corp	2.564.277	(1.406.849)	-	1.157.428	(1.406.849)	1.406.849	-	-
Insgesamt	12.379.899	(9.738.973)	-	2.640.926	(10.560.096)	9.738.973	-	(821.123)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	17.116.276	(12.281.584)
OTC-Kontrakt	3.085	(2.136.323)
Insgesamt	17.119.361	(14.417.907)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Barclays Bank Plc	667.762	(299.724)	(300.000)	68.038	(299.724)	299.724	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	(49.809)	-	-	(49.809)
Citibank NA	2.231.444	(1.759.641)	(230.000)	241.803	(1.759.641)	1.759.641	-	-
Deutsche Bank AG	173.188	(173.188)	-	-	(349.625)	173.188	100.000	(76.437)
Goldman Sachs International	2.999.104	(2.999.104)	-	-	(4.210.723)	2.999.104	1.211.619	-
HSBC Bank Plc	965.768	(568.492)	(397.276)	-	(568.492)	568.492	-	-
JPMorgan Chase Bank	2.252.252	(1.514.023)	(738.229)	-	(1.514.023)	1.514.023	-	-
Morgan Stanley	630.393	(470.787)	(120.000)	39.606	(470.787)	470.787	-	-
Standard Chartered Bank	1.617.740	(426.665)	(290.000)	901.075	(426.665)	426.665	-	-
State Street Bank and Trust Co	35.221	(35.221)	-	-	(602.118)	35.221	530.000	(36.897)
UBS AG	646.651	(153)	-	646.498	(153)	153	-	-
Westpac Banking Corp	4.899.838	(4.166.147)	-	733.691	(4.166.147)	4.166.147	-	-
Insgesamt	17.119.361	(12.413.145)	(2.075.505)	2.630.711	(14.417.907)	12.413.145	1.841.619	(163.143)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt – Local Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	14.987.459	(9.665.447)
OTC-Kontrakt	734.076	(2.207.907)
Insgesamt	15.721.535	(11.873.354)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Barclays Bank Plc	380.673	(380.673)	-	-	(1.344.347)	380.673	-	(963.674)
BNP Paribas	393.015	(393.015)	-	-	(472.729)	393.015	-	(79.714)
Brown Brothers Harriman	34.283	-	-	34.283	-	-	-	-
Citibank NA	2.888.351	(1.791.727)	-	1.096.624	(1.791.727)	1.791.727	-	-
Deutsche Bank AG	577.311	-	-	577.311	-	-	-	-
Goldman Sachs International	5.189.853	(3.515.469)	(1.674.384)	-	(3.515.469)	3.515.469	-	-
HSBC Bank Plc	229.243	(229.243)	-	-	(740.115)	229.243	370.000	(140.872)
JPMorgan Chase Bank	2.456.371	(2.456.371)	-	-	(2.956.556)	2.456.371	500.185	-
Morgan Stanley	1.113.150	(45.688)	(1.000.000)	67.462	(45.688)	45.688	-	-
Standard Chartered Bank	740.156	(198)	-	739.958	(198)	198	-	-
State Street Bank and Trust Co	91.230	(91.230)	-	-	(748.662)	91.230	510.000	(147.432)
UBS AG	1.205.891	(241.117)	-	964.774	(241.117)	241.117	-	-
Westpac Banking Corp	422.008	(16.746)	-	405.262	(16.746)	16.746	-	-
Insgesamt	15.721.535	(9.161.477)	(2.674.384)	3.885.674	(11.873.354)	9.161.477	1.380.185	(1.331.692)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	6.637.946	(2.075.226)
OTC-Kontrakt	701	(627.829)
Insgesamt	6.638.647	(2.703.055)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Barclays Bank Plc	230.287	(111.942)	-	118.345	(111.942)	111.942	-	-
BNP Paribas	9.403	(2.582)	-	6.821	(2.582)	2.582	-	-
Brown Brothers Harriman	-	-	-	-	(5.632)	-	-	(5.632)
Citibank NA	316.590	(316.590)	-	-	(491.860)	316.590	175.270	-
Deutsche Bank AG	32.343	-	-	32.343	-	-	-	-
Goldman Sachs International	4.403.030	(1.112.359)	-	3.290.671	(1.112.359)	1.112.359	-	-
HSBC Bank Plc	203.668	(108.659)	-	95.009	(108.659)	108.659	-	-
JPMorgan Chase Bank	165.310	(165.310)	-	-	(264.497)	165.310	99.187	-
Morgan Stanley	598.073	(138.351)	(390.000)	69.722	(138.351)	138.351	-	-
Standard Chartered Bank	387.662	(274.429)	-	113.233	(274.429)	274.429	-	-
State Street Bank and Trust Co	14.466	(14.466)	-	-	(128.391)	14.466	-	(113.925)
UBS AG	92.872	-	-	92.872	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	184.943	(64.353)	-	120.590	(64.353)	64.353	-	-
Insgesamt	6.638.647	(2.309.041)	(390.000)	3.939.606	(2.703.055)	2.309.041	274.457	(119.557)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	4.031.358	(2.058.976)
OTC-Kontrakt	938.323	(678.507)
Insgesamt	4.969.681	(2.737.483)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Barclays Bank Plc	44.223	(18.841)	-	25.382	(18.841)	18.841	-	-
Citibank NA	521.190	(295.375)	-	225.815	(295.375)	295.375	-	-
Deutsche Bank AG	102.206	-	-	102.206	-	-	-	-
Goldman Sachs International	1.657.848	(836.696)	(770.000)	51.152	(836.696)	836.696	-	-
HSBC Bank Plc	62.182	(62.182)	-	-	(126.410)	62.182	-	(64.228)
JPMorgan Chase Bank	370.316	(370.316)	-	-	(638.040)	370.316	220.000	(47.724)
Morgan Stanley	257.955	(2.938)	(70.000)	185.017	(2.938)	2.938	-	-
Standard Chartered Bank	3.397	(3.397)	-	-	(7.546)	3.397	-	(4.149)
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(125.834)	-	-	(125.834)
UBS AG	23.750	(23.750)	-	-	(492.423)	23.750	-	(468.673)
Westpac Banking Corp	1.926.614	(193.380)	-	1.733.234	(193.380)	193.380	-	-
Insgesamt	4.969.681	(1.806.875)	(840.000)	2.322.806	(2.737.483)	1.806.875	220.000	(710.608)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	2.325.031	(284.238)
OTC-Kontrakt	57	-
Insgesamt	2.325.088	(284.238)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Barclays Bank Plc	17.042	(8.742)	-	8.300	(8.742)	8.742	-	-
BNP Paribas	359.821	-	-	359.821	-	-	-	-
Citibank NA	24.963	(23.177)	-	1.786	(23.177)	23.177	-	-
Deutsche Bank AG	2.346	(2.058)	-	288	(2.058)	2.058	-	-
Goldman Sachs International	15.848	(15.848)	-	-	(34.123)	15.848	-	(18.275)
HSBC Bank Plc	17.027	(8.071)	-	8.956	(8.071)	8.071	-	-
JPMorgan Chase Bank	15.993	(7.035)	-	8.958	(7.035)	7.035	-	-
Morgan Stanley	6.332	(5.193)	-	1.139	(5.193)	5.193	-	-
Standard Chartered Bank	29.241	(29.241)	-	-	(159.276)	29.241	-	(130.035)
State Street Bank and Trust Co	32.234	(13.021)	-	19.213	(13.021)	13.021	-	-
Westpac Banking Corp	1.804.241	(23.542)	-	1.780.699	(23.542)	23.542	-	-
Insgesamt	2.325.088	(135.928)	-	2.189.160	(284.238)	135.928	-	(148.310)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	446.879	(340.697)
Insgesamt	446.879	(340.697)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Barclays Bank Plc	4.647	(1.063)	-	3.584	(1.063)	1.063	-	-
BNP Paribas	112.720	(3.562)	-	109.158	(3.562)	3.562	-	-
Citibank NA	28.911	(28.911)	-	-	(41.714)	28.911	-	(12.803)
Deutsche Bank AG	7.148	(489)	-	6.659	(489)	489	-	-
Goldman Sachs International	173.055	(17.275)	-	155.780	(17.275)	17.275	-	-
HSBC Bank Plc	7.242	(7.242)	-	-	(10.109)	7.242	-	(2.867)
JPMorgan Chase Bank	29.037	(26.319)	-	2.718	(26.319)	26.319	-	-
Morgan Stanley	10.524	(4.456)	-	6.068	(4.456)	4.456	-	-
Standard Chartered Bank	2.657	(2.657)	-	-	(204.043)	2.657	-	(201.386)
State Street Bank and Trust Co	1.798	(479)	-	1.319	(479)	479	-	-
Westpac Banking Corp	69.140	(31.188)	-	37.952	(31.188)	31.188	-	-
Insgesamt	446.879	(123.641)	-	323.238	(340.697)	123.641	-	(217.056)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	1.272.409	(787.152)
Insgesamt	1.272.409	(787.152)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	220.656	(110.722)	-	109.934	(110.722)	110.722	-	-
Royal Bank of Canada	11.819	(11.819)	-	-	(20.649)	11.819	-	(8.830)
UBS AG	370.440	(79.813)	-	290.627	(79.813)	79.813	-	-
Westpac Banking Corp	669.494	(575.968)	-	93.526	(575.968)	575.968	-	-
Insgesamt	1.272.409	(778.322)	-	494.087	(787.152)	778.322	-	(8.830)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	1.053.813	(666.859)
Insgesamt	1.053.813	(666.859)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	223.814	(139.085)	-	84.729	(139.085)	139.085	-	-
Royal Bank of Canada	567	(567)	-	-	(2.673)	567	-	(2.106)
UBS AG	21.918	(10.004)	-	11.914	(10.004)	10.004	-	-
Westpac Banking Corp	807.514	(515.097)	-	292.417	(515.097)	515.097	-	-
Insgesamt	1.053.813	(664.753)	-	389.060	(666.859)	664.753	-	(2.106)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte EUR	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten EUR
Devisenterminkontrakte	25.383	(1.117.757)
Insgesamt	25.383	(1.117.757)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR
BNP Paribas	864	(864)	-	-	(512.453)	864	-	(511.589)
Goldman Sachs International	-	-	-	-	(30.722)	-	-	(30.722)
Standard Chartered Bank	2.193	(2.193)	-	-	(32.886)	2.193	-	(30.693)
State Street Bank and Trust Co	178	(178)	-	-	(14.181)	178	-	(14.003)
Westpac Banking Corp	22.148	(22.148)	-	-	(527.515)	22.148	-	(505.367)
Insgesamt	25.383	(25.383)	-	-	(1.117.757)	25.383	-	(1.092.374)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Euro Bond Absolute Return (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte EUR	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten EUR
Devisenterminkontrakte	39.745	(1.032.074)
Insgesamt	39.745	(1.032.074)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR
Goldman Sachs International	608	(608)	-	-	(10.898)	608	-	(10.290)
Standard Chartered Bank	5.615	(5.615)	-	-	(29.576)	5.615	-	(23.961)
State Street Bank and Trust Co	17.588	(5.247)	-	12.341	(5.247)	5.247	-	-
Westpac Banking Corp	15.934	(15.934)	-	-	(986.353)	15.934	-	(970.419)
Insgesamt	39.745	(27.404)	-	12.341	(1.032.074)	27.404	-	(1.004.670)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte EUR	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten EUR
Devisenterminkontrakte	643.091	(1.281.452)
OTC-Kontrakt	18.355	-
Insgesamt	661.446	(1.281.452)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR
Goldman Sachs International	23.074	(19.823)	-	3.251	(19.823)	19.823	-	-
UBS AG	596.607	(596.607)	-	-	(1.014.198)	596.607	-	(417.591)
Westpac Banking Corp	41.765	(41.765)	-	-	(247.431)	41.765	-	(205.666)
Insgesamt	661.446	(658.195)	-	3.251	(1.281.452)	658.195	-	(623.257)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte EUR	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten EUR
Devisenterminkontrakte	1.258.544	(3.113.019)
Insgesamt	1.258.544	(3.113.019)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten EUR	Erhaltene Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR
Goldman Sachs International	20.066	(20.066)	-	-	(39.074)	20.066	-	(19.008)
UBS AG	35.438	(16.930)	-	18.508	(16.930)	16.930	-	-
Westpac Banking Corp	1.203.040	(1.203.040)	-	-	(3.057.015)	1.203.040	-	(1.853.975)
Insgesamt	1.258.544	(1.240.036)	-	18.508	(3.113.019)	1.240.036	-	(1.872.983)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Event Driven[2]

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	4.057.943	(155.365)
OTC-Kontrakt	959.529	-
Insgesamt	5.017.472	(155.365)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Morgan Stanley	959.529	-	-	959.529	-	-	-	-
State Street Bank and Trust Co	3.752.797	(6)	-	3.752.791	(6)	6	-	-
Westpac Banking Corp	305.146	(155.359)	-	149.787	(155.359)	155.359	-	-
Insgesamt	5.017.472	(155.365)	-	4.862.107	(155.365)	155.365	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Event Driven[2] (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	918.069	(18.616)
OTC-Kontrakt	18.364	-
Insgesamt	936.433	(18.616)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Morgan Stanley	18.364	-	-	18.364	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	918.069	(18.616)	-	899.453	(18.616)	18.616	-	-
Insgesamt	936.433	(18.616)	-	917.817	(18.616)	18.616	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Bond

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	3.337.129	(3.195.228)
Insgesamt	3.337.129	(3.195.228)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
BNP Paribas	460.011	(460.011)	-	-	(688.009)	460.011	-	(227.998)
Canadian Imperial Bank of Commerce	28.969	-	-	28.969	-	-	-	-
Citibank NA	-	-	-	-	(498)	-	-	(498)
Deutsche Bank AG	39.583	(18.794)	-	20.789	(18.794)	18.794	-	-
Goldman Sachs International	840.078	(800.823)	-	39.255	(800.823)	800.823	-	-
Royal Bank of Canada	327.646	(21.429)	-	306.217	(21.429)	21.429	-	-
Société Générale	207.886	(207.886)	-	-	(271.737)	207.886	-	(63.851)
Standard Chartered Bank	445.291	(322.164)	-	123.127	(322.164)	322.164	-	-
State Street Bank and Trust Co	430.936	(417.433)	-	13.503	(417.433)	417.433	-	-
UBS AG	291.560	(291.560)	-	-	(456.074)	291.560	-	(164.514)
Westpac Banking Corp	265.169	(198.267)	-	66.902	(198.267)	198.267	-	-
Insgesamt	3.337.129	(2.738.367)	-	598.762	(3.195.228)	2.738.367	-	(456.861)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	2.638.428	(1.908.377)
Insgesamt	2.638.428	(1.908.377)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlich-keiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicher-heiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
BNP Paribas	442.935	(217.047)	-	225.888	(217.047)	217.047	-	-
Goldman Sachs International	120.460	(120.460)	-	-	(615.311)	120.460	280.000	(214.851)
Royal Bank of Canada	30.889	(30.889)	-	-	(55.928)	30.889	-	(25.039)
Société Générale	28.962	(28.962)	-	-	(161.628)	28.962	-	(132.666)
Standard Chartered Bank	1.202.093	(124.265)	-	1.077.828	(124.265)	124.265	-	-
State Street Bank and Trust Co	203.836	(61.874)	-	141.962	(61.874)	61.874	-	-
UBS AG	381.622	(381.622)	-	-	(528.995)	381.622	-	(147.373)
Westpac Banking Corp	227.631	(143.329)	-	84.302	(143.329)	143.329	-	-
Insgesamt	2.638.428	(1.108.448)	-	1.529.980	(1.908.377)	1.108.448	280.000	(519.929)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	281.732	-
Insgesamt	281.732	-

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
UBS AG	181.693	-	-	181.693	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	100.039	-	-	100.039	-	-	-	-
Insgesamt	281.732	-	-	281.732	-	-	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	523.987	(417)
Insgesamt	523.987	(417)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
State Street Bank and Trust Co	34	-	-	34	-	-	-	-
UBS AG	3.888	-	-	3.888	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	520.065	(417)	-	519.648	(417)	417	-	-
Insgesamt	523.987	(417)	-	523.570	(417)	417	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Equity Megatrends

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	444	-
Insgesamt	444	-

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Westpac Banking Corp	444	-	-	444	-	-	-	-
Insgesamt	444	-	-	444	-	-	-	-

31. Dezember 2022

Keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten und Wertpapierleihgeschäften.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	8.130.820	(3.447.658)
OTC-Kontrakt	268.263	-
Insgesamt	8.399.083	(3.447.658)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	112.698	(112.698)	-	-	(117.706)	112.698	-	(5.008)
JPMorgan Chase Bank	268.263	-	(200.000)	68.263	-	-	-	-
Royal Bank of Canada	214.612	(214.612)	-	-	(562.562)	214.612	-	(347.950)
State Street Bank and Trust Co	3.658.224	(2.539.881)	-	1.118.343	(2.539.881)	2.539.881	-	-
Westpac Banking Corp	4.145.286	(227.509)	-	3.917.777	(227.509)	227.509	-	-
Insgesamt	8.399.083	(3.094.700)	(200.000)	5.104.383	(3.447.658)	3.094.700	-	(352.958)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	29.033.515	(10.857.921)
OTC-Kontrakt	-	(632.100)
Insgesamt	29.033.515	(11.490.021)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	521.466	(521.466)	-	-	(657.911)	521.466	-	(136.445)
JPMorgan Chase Bank	154.429	(154.429)	-	-	(604.889)	154.429	760.000	309.540
State Street Bank and Trust Co	25.713.338	(5.911.810)	-	19.801.528	(5.911.810)	5.911.810	-	-
Westpac Banking Corp	2.644.282	(2.644.282)	-	-	(4.315.411)	2.644.282	-	(1.671.129)
Insgesamt	29.033.515	(9.231.987)	-	19.801.528	(11.490.021)	9.231.987	760.000	(1.498.034)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global SDG Engagement

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	11.935.674	(6.738.234)
Insgesamt	11.935.674	(6.738.234)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	131.470	(131.470)	-	-	(166.547)	131.470	-	(35.077)
UBS AG	3.486.572	(3.486.572)	-	-	(5.647.348)	3.486.572	-	(2.160.776)
Westpac Banking Corp	8.317.632	(924.339)	-	7.393.293	(924.339)	924.339	-	-
Insgesamt	11.935.674	(4.542.381)	-	7.393.293	(6.738.234)	4.542.381	-	(2.195.853)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global SDG Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	12.873.530	(9.426.254)
OTC-Kontrakt	13.411	-
Insgesamt	12.886.941	(9.426.254)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	43.567	(43.567)	-	-	(84.265)	43.567	-	(40.698)
UBS AG	503.272	(74)	-	503.198	(74)	74	-	-
Westpac Banking Corp	12.340.102	(9.341.915)	-	2.998.187	(9.341.915)	9.341.915	-	-
Insgesamt	12.886.941	(9.385.556)	-	3.501.385	(9.426.254)	9.385.556	-	(40.698)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global High Yield Sustainable Action*

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	7.620	(358.029)
Insgesamt	7.620	(358.029)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(356.484)	-	-	(356.484)
Westpac Banking Corp	7.620	(1.545)	-	6.075	(1.545)	1.545	-	-
Insgesamt	7.620	(1.545)	-	6.075	(358.029)	1.545	-	(356.484)

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	1.115	(1.107.450)
Insgesamt	1.115	(1.107.450)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Standard Chartered Bank	1.101	(191)	-	910	(191)	191	-	-
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(314.049)	-	-	(314.049)
UBS AG	-	-	-	-	(63.314)	-	-	(63.314)
Westpac Banking Corp	14	(14)	-	-	(729.896)	14	-	(729.882)
Insgesamt	1.115	(205)	-	910	(1.107.450)	205	-	(1.107.245)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Investment Grade Credit (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	16.124	(1.642.819)
Insgesamt	16.124	(1.642.819)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
JPMorgan Chase Bank	12.361	(1.985)	-	10.376	(1.985)	1.985	-	-
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(1.350.854)	-	-	(1.350.854)
UBS AG	-	-	-	-	(289.980)	-	-	(289.980)
Westpac Banking Corp	3.763	-	-	3.763	-	-	-	-
Insgesamt	16.124	(1.985)	-	14.139	(1.642.819)	1.985	-	(1.640.834)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	4.673.609	(6.577.836)
Insgesamt	4.673.609	(6.577.836)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
BNP Paribas	978.221	(978.221)	-	-	(1.289.214)	978.221	-	(310.993)
Citibank NA	-	-	-	-	(925)	-	-	(925)
Deutsche Bank AG	10.673	(10.673)	-	-	(139.651)	10.673	-	(128.978)
Goldman Sachs International	1.615.491	(1.324.027)	-	291.464	(1.324.027)	1.324.027	-	-
JPMorgan Chase Bank	45.426	-	-	45.426	-	-	-	-
Royal Bank of Canada	15.527	(15.527)	-	-	(148.425)	15.527	-	(132.898)
Société Générale	78.724	(78.724)	-	-	(153.133)	78.724	-	(74.409)
Standard Chartered Bank	308.710	(308.710)	-	-	(541.519)	308.710	-	(232.809)
State Street Bank and Trust Co	660.093	(660.093)	-	-	(1.678.714)	660.093	-	(1.018.621)
UBS AG	521.044	(521.044)	-	-	(809.174)	521.044	-	(288.130)
Westpac Banking Corp	439.700	(439.700)	-	-	(493.054)	439.700	-	(53.354)
Insgesamt	4.673.609	(4.336.719)	-	336.890	(6.577.836)	4.336.719	-	(2.241.117)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	2.069.747	(4.857.533)
Insgesamt	2.069.747	(4.857.533)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
BNP Paribas	356.289	(352.886)	-	3.403	(352.886)	352.886	-	-
Deutsche Bank AG	7.783	(7.783)	-	-	(14.157)	7.783	-	(6.374)
Goldman Sachs International	135.105	(135.105)	-	-	(793.090)	135.105	-	(657.985)
JPMorgan Chase Bank	622	-	-	622	-	-	-	-
Royal Bank of Canada	47.862	(95)	-	47.767	(95)	95	-	-
Standard Chartered Bank	265.077	(265.077)	-	-	(268.202)	265.077	-	(3.125)
State Street Bank and Trust Co	172.765	(94.768)	-	77.997	(94.768)	94.768	-	-
UBS AG	169.137	(169.137)	-	-	(2.748.144)	169.137	-	(2.579.007)
Westpac Banking Corp	915.107	(586.191)	-	328.916	(586.191)	586.191	-	-
Insgesamt	2.069.747	(1.611.042)	-	458.705	(4.857.533)	1.611.042	-	(3.246.491)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	422.478	(250.684)
Insgesamt	422.478	(250.684)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Goldman Sachs International	10.067	(10.067)	-	-	(13.728)	10.067	-	(3.661)
UBS AG	211.249	(7.649)	-	203.600	(7.649)	7.649	-	-
Westpac Banking Corp	201.162	(201.162)	-	-	(229.307)	201.162	-	(28.145)
Insgesamt	422.478	(218.878)	-	203.600	(250.684)	218.878	-	(31.806)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Real Estate Securities (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	866.015	(147.763)
Insgesamt	866.015	(147.763)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	41.770	(37.969)	-	3.801	(37.969)	37.969	-	-
UBS AG	8.091	(1.801)	-	6.290	(1.801)	1.801	-	-
Westpac Banking Corp	816.154	(107.993)	-	708.161	(107.993)	107.993	-	-
Insgesamt	866.015	(147.763)	-	718.252	(147.763)	147.763	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	66.448	(46.897)
Insgesamt	66.448	(46.897)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Goldman Sachs International	512	(454)	-	58	(454)	454	-	-
UBS AG	32.773	(22.275)	-	10.498	(22.275)	22.275	-	-
Westpac Banking Corp	33.163	(24.168)	-	8.995	(24.168)	24.168	-	-
Insgesamt	66.448	(46.897)	-	19.551	(46.897)	46.897	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	125.312	(90.456)
Insgesamt	125.312	(90.456)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	1.555	(1.312)	-	243	(1.312)	1.312	-	-
UBS AG	316	-	-	316	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	123.441	(89.144)	-	34.297	(89.144)	89.144	-	-
Insgesamt	125.312	(90.456)	-	34.856	(90.456)	90.456	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	40.709.223	(15.391.406)
OTC-Kontrakt	-	(51.928)
Insgesamt	40.709.223	(15.443.334)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	8.518.424	(1.130.109)	-	7.388.315	(1.130.109)	1.130.109	-	-
JPMorgan Chase Bank	-	-	-	-	(51.928)	-	-	(51.928)
UBS AG	18.392.576	(8.661.964)	-	9.730.612	(8.661.964)	8.661.964	-	-
Westpac Banking Corp	13.798.223	(5.599.333)	-	8.198.890	(5.599.333)	5.599.333	-	-
Insgesamt	40.709.223	(15.391.406)	-	25.317.817	(15.443.334)	15.391.406	-	(51.928)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	55.707.544	(25.192.706)
OTC-Kontrakt	-	(404.963)
Insgesamt	55.707.544	(25.597.669)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Goldman Sachs International	8.246.368	(1.647.022)	-	6.599.346	(1.647.022)	1.647.022	-	-
JPMorgan Chase Bank	-	-	-	-	(404.963)	-	300.000	(104.963)
UBS AG	9.516.420	(3.564.399)	-	5.952.021	(3.564.399)	3.564.399	-	-
Westpac Banking Corp	37.944.756	(19.981.285)	-	17.963.471	(19.981.285)	19.981.285	-	-
Insgesamt	55.707.544	(25.192.706)	-	30.514.838	(25.597.669)	25.192.706	300.000	(104.963)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	299.135	(60.136)
Insgesamt	299.135	(60.136)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Standard Chartered Bank	6.569	(5.960)	-	609	(5.960)	5.960	-	-
State Street Bank and Trust Co	38.240	(1.950)	-	36.290	(1.950)	1.950	-	-
UBS AG	207.008	(14.058)	-	192.950	(14.058)	14.058	-	-
Westpac Banking Corp	47.318	(38.168)	-	9.150	(38.168)	38.168	-	-
Insgesamt	299.135	(60.136)	-	238.999	(60.136)	60.136	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	453.339	(78.732)
Insgesamt	453.339	(78.732)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
JPMorgan Chase Bank	4.236	(4.236)	-	-	(16.573)	4.236	-	(12.337)
Standard Chartered Bank	16.275	(3.158)	-	13.117	(3.158)	3.158	-	-
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(2.383)	-	-	(2.383)
UBS AG	2.818	(2.818)	-	-	(9.094)	2.818	-	(6.276)
Westpac Banking Corp	430.010	(47.524)	-	382.486	(47.524)	47.524	-	-
Insgesamt	453.339	(57.736)	-	395.603	(78.732)	57.736	-	(20.996)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Japanischen Aktienengagement

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte JPY	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten JPY
Devisenterminkontrakte	128.484.079	(42.002.252)
Insgesamt	128.484.079	(42.002.252)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten JPY	Erhaltene Sicherheiten[a] JPY	Nettobetrag[b] JPY	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte JPY	Verpfändete Sicherheiten[a] JPY	Nettobetrag[b] JPY
Brown Brothers Harriman	69.722	(23.619)	-	46.103	(23.619)	23.619	-	-
Standard Chartered Bank	2.860.241	(1.032.189)	-	1.828.052	(1.032.189)	1.032.189	-	-
State Street Bank and Trust Co	3.449.741	(3.449.741)	-	-	(39.519.881)	3.449.741	-	(36.070.140)
Westpac Banking Corp	122.104.375	(1.426.563)	-	120.677.812	(1.426.563)	1.426.563	-	-
Insgesamt	128.484.079	(5.932.112)	-	122.551.967	(42.002.252)	5.932.112	-	(36.070.140)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte JPY	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten JPY
Devisenterminkontrakte	44.531.344	(141.215.249)
Insgesamt	44.531.344	(141.215.249)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten JPY	Erhaltene Sicherheiten[a] JPY	Nettobetrag[b] JPY	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge JPY	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte JPY	Verpfändete Sicherheiten[a] JPY	Nettobetrag[b] JPY
Standard Chartered Bank	9.748.767	(9.748.767)	-	-	(16.417.996)	9.748.767	-	(6.669.229)
State Street Bank and Trust Co	14.707.131	(14.707.131)	-	-	(52.892.460)	14.707.131	-	(38.185.329)
Westpac Banking Corp	20.075.446	(20.075.446)	-	-	(71.904.793)	20.075.446	-	(51.829.347)
Insgesamt	44.531.344	(44.531.344)	-	-	(141.215.249)	44.531.344	-	(96.683.905)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte EUR	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten EUR
Devisenterminkontrakte	4.627.295	(4.613.695)
Insgesamt	4.627.295	(4.613.695)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR	Erhaltene Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR
BNP Paribas	915.663	(915.663)	-	-	(1.216.937)	915.663	-	(301.274)
Citibank NA	-	-	-	-	(286)	-	-	(286)
Deutsche Bank AG	565.493	(187.451)	-	378.042	(187.451)	187.451	-	-
Goldman Sachs International	1.337.289	(852.517)	-	484.772	(852.517)	852.517	-	-
Standard Chartered Bank	221.272	(221.272)	-	-	(612.890)	221.272	-	(391.618)
State Street Bank and Trust Co	663.217	(663.217)	-	-	(697.543)	663.217	-	(34.326)
UBS AG	478.535	(478.535)	-	-	(592.588)	478.535	-	(114.053)
Westpac Banking Corp	445.826	(445.826)	-	-	(453.483)	445.826	-	(7.657)
Insgesamt	4.627.295	(3.764.481)	-	862.814	(4.613.695)	3.764.481	-	(849.214)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Macro Opportunities FX (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte EUR	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten EUR
Devisenterminkontrakte	3.617.207	(4.428.576)
Insgesamt	3.617.207	(4.428.576)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR	Erhaltene Sicherheiten[(a)] EUR	Nettobetrag[(b)] EUR	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten[(a)] EUR	Nettobetrag[(b)] EUR
BNP Paribas	1.253.848	(1.224.102)	-	29.746	(1.224.102)	1.224.102	-	-
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	(702.163)	-	-	(702.163)
Goldman Sachs International	346.789	(346.789)	-	-	(1.143.875)	346.789	-	(797.086)
Standard Chartered Bank	490.351	(391.878)	-	98.473	(391.878)	391.878	-	-
State Street Bank and Trust Co	415.549	(168.777)	-	246.772	(168.777)	168.777	-	-
UBS AG	382.277	(298.409)	-	83.868	(298.409)	298.409	-	-
Westpac Banking Corp	728.393	(499.372)	-	229.021	(499.372)	499.372	-	-
Insgesamt	3.617.207	(2.929.327)	-	687.880	(4.428.576)	2.929.327	-	(1.499.249)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income*

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	160.435	(584.335)
Insgesamt	160.435	(584.335)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
BNP Paribas	40.724	(39.912)	-	812	(39.912)	39.912	-	-
Brown Brothers Harriman	11	-	-	11	-	-	-	-
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	(21.485)	-	-	(21.485)
Goldman Sachs International	19.681	(19.681)	-	-	(47.002)	19.681	-	(27.321)
JPMorgan Chase Bank	18	-	-	18	-	-	-	-
Royal Bank of Canada	68	-	-	68	-	-	-	-
Standard Chartered Bank	51.221	(10.722)	-	40.499	(10.722)	10.722	-	-
State Street Bank and Trust Co	14.764	(14.764)	-	-	(454.800)	14.764	-	(440.036)
UBS AG	33.175	(10.351)	-	22.824	(10.351)	10.351	-	-
Westpac Banking Corp	773	(63)	-	710	(63)	63	-	-
Insgesamt	160.435	(95.493)	-	64.942	(584.335)	95.493	-	(488.842)

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	20.789	(10.365)
Insgesamt	20.789	(10.365)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	510	(510)	-	-	(820)	510	-	(310)
UBS AG	10.281	(55)	-	10.226	(55)	55	-	-
Westpac Banking Corp	9.998	(9.490)	-	508	(9.490)	9.490	-	-
Insgesamt	20.789	(10.055)	-	10.734	(10.365)	10.055	-	(310)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Next Generation Mobility (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	294.328	(213.661)
Insgesamt	294.328	(213.661)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	9.006	(9.006)	-	-	(10.518)	9.006	-	(1.512)
UBS AG	80	(2)	-	78	(2)	2	-	-
Westpac Banking Corp	285.242	(203.141)	-	82.101	(203.141)	203.141	-	-
Insgesamt	294.328	(212.149)	-	82.179	(213.661)	212.149	-	(1.512)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	127.055	(135.330)
OTC-Kontrakt	167	-
Insgesamt	127.222	(135.330)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
BNP Paribas	15.028	-	-	15.028	-	-	-	-
Citibank NA	28.364	(10.417)	-	17.947	(10.417)	10.417	-	-
Goldman Sachs International	25.702	-	-	25.702	-	-	-	-
JPMorgan Chase Bank	25.414	(19.642)	-	5.772	(19.642)	19.642	-	-
Morgan Stanley	3.429	(3.429)	-	-	(53.568)	3.429	-	(50.139)
Standard Chartered Bank	22.248	(22.248)	-	-	(51.167)	22.248	-	(28.919)
UBS AG	7.037	(536)	-	6.501	(536)	536	-	-
Insgesamt	127.222	(56.272)	-	70.950	(135.330)	56.272	-	(79.058)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Responsible Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	34.382	(84.733)
Insgesamt	34.382	(84.733)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
BNP Paribas	3.444	(1)	-	3.443	(1)	1	-	-
Citibank NA	2.050	(2.050)	-	-	(11.771)	2.050	-	(9.721)
Goldman Sachs International	10.822	-	-	10.822	-	-	-	-
JPMorgan Chase Bank	17.674	(17.674)	-	-	(29.242)	17.674	-	(11.568)
Morgan Stanley	392	(392)	-	-	(864)	392	-	(472)
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	(42.855)	-	-	(42.855)
Insgesamt	34.382	(20.117)	-	14.265	(84.733)	20.117	-	(64.616)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	64.552.046	(9.131.675)
Insgesamt	64.552.046	(9.131.675)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Citibank NA	106.705	(106.705)	-	-	(147.411)	106.705	-	(40.706)
Goldman Sachs International	36.534.923	-	-	36.534.923	-	-	-	-
HSBC Bank Plc	36.950	(36.950)	-	-	(3.382.906)	36.950	3.345.956	-
Royal Bank of Canada	18.468.179	-	-	18.468.179	-	-	-	-
UBS AG	8.810.283	(4.951.663)	-	3.858.620	(4.951.663)	4.951.663	-	-
Westpac Banking Corp	595.006	(595.006)	-	-	(649.695)	595.006	-	(54.689)
Insgesamt	64.552.046	(5.690.324)	-	58.861.722	(9.131.675)	5.690.324	3.345.956	(95.395)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	46.700.064	(23.986.773)
Insgesamt	46.700.064	(23.986.773)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Citibank NA	-	-	-	-	(5.698.738)	-	-	(5.698.738)
Goldman Sachs International	168.124	(168.124)	-	-	(370.635)	168.124	-	(202.511)
Royal Bank of Canada	210	-	-	210	-	-	-	-
UBS AG	45.553.017	(16.806.182)	-	28.746.835	(16.806.182)	16.806.182	-	-
Westpac Banking Corp	978.713	(978.713)	-	-	(1.111.218)	978.713	-	(132.505)
Insgesamt	46.700.064	(17.953.019)	-	28.747.045	(23.986.773)	17.953.019	-	(6.033.754)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	15.254.920	(3.114.085)
Insgesamt	15.254.920	(3.114.085)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	134.884	(69.533)	-	65.351	(69.533)	69.533	-	-
UBS AG	6.142.919	(1.376.770)	-	4.766.149	(1.376.770)	1.376.770	-	-
Westpac Banking Corp	8.977.117	(1.667.782)	-	7.309.335	(1.667.782)	1.667.782	-	-
Insgesamt	15.254.920	(3.114.085)	-	12.140.835	(3.114.085)	3.114.085	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	23.012.144	(5.286.451)
Insgesamt	23.012.144	(5.286.451)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	150.807	(31.799)	-	119.008	(31.799)	31.799	-	-
UBS AG	1.077.478	(513.291)	-	564.187	(513.291)	513.291	-	-
Westpac Banking Corp	21.783.859	(4.741.361)	-	17.042.498	(4.741.361)	4.741.361	-	-
Insgesamt	23.012.144	(5.286.451)	-	17.725.693	(5.286.451)	5.286.451	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	20.251.351	(5.513.615)
OTC-Kontrakt	461.585	-
OTC Swaptions	15.122	-
Insgesamt	20.728.058	(5.513.615)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Barclays Bank Plc	50.289	(14.141)	-	36.148	(14.141)	14.141	-	-
Citibank NA	231.474	(61.555)	-	169.919	(61.555)	61.555	-	-
Goldman Sachs International	2.664.490	(1.338.617)	(520.000)	805.873	(1.338.617)	1.338.617	-	-
HSBC Bank Plc	13.642	(3.157)	-	10.485	(3.157)	3.157	-	-
JPMorgan Chase Bank	38.574	(8.209)	-	30.365	(8.209)	8.209	-	-
Morgan Stanley	38.972	(8.589)	-	30.383	(8.589)	8.589	-	-
Royal Bank of Canada	109.028	(109.028)	-	-	(2.607.384)	109.028	-	(2.498.356)
Standard Chartered Bank	20.617	(11.152)	-	9.465	(11.152)	11.152	-	-
UBS AG	2.146.973	(92.890)	-	2.054.083	(92.890)	92.890	-	-
Westpac Banking Corp	15.413.999	(1.367.921)	-	14.046.078	(1.367.921)	1.367.921	-	-
Insgesamt	20.728.058	(3.015.259)	(520.000)	17.192.799	(5.513.615)	3.015.259	-	(2.498.356)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	29.520.687	(7.161.491)
OTC-Kontrakt	-	(3.863.949)
Insgesamt	29.520.687	(11.025.440)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Barclays Bank Plc	19.490	-	-	19.490	-	-	-	-
Citibank NA	120.797	(120.797)	-	-	(539.198)	120.797	-	(418.401)
Goldman Sachs International	911.721	(911.721)	-	-	(7.314.951)	911.721	3.390.000	(3.013.230)
JPMorgan Chase Bank	306.288	(50.895)	-	255.393	(50.895)	50.895	-	-
Morgan Stanley	13.556	-	-	13.556	-	-	-	-
Royal Bank of Canada	550.752	(550.752)	-	-	(1.936.869)	550.752	-	(1.386.117)
UBS AG	986.309	(624.056)	-	362.253	(624.056)	624.056	-	-
Westpac Banking Corp	26.611.774	(559.471)	-	26.052.303	(559.471)	559.471	-	-
Insgesamt	29.520.687	(2.817.692)	-	26.702.995	(11.025.440)	2.817.692	3.390.000	(4.817.748)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	16.926	(496)
Insgesamt	16.926	(496)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Goldman Sachs International	105	(105)	-	-	(126)	105	-	(21)
Standard Chartered Bank	15	-	-	15	-	-	-	-
State Street Bank and Trust Co	843	-	-	843	-	-	-	-
UBS AG	1.040	-	-	1.040	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	14.923	(370)	-	14.553	(370)	370	-	-
Insgesamt	16.926	(475)	-	16.451	(496)	475	-	(21)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	282.337	(29.229)
Insgesamt	282.337	(29.229)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Goldman Sachs International	4.110	(4.110)	-	-	(11.267)	4.110	-	(7.157)
Standard Chartered Bank	664	(191)	-	473	(191)	191	-	-
State Street Bank and Trust Co	7.594	-	-	7.594	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	269.969	(17.771)	-	252.198	(17.771)	17.771	-	-
Insgesamt	282.337	(22.072)	-	260.265	(29.229)	22.072	-	(7.157)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	1.906.675	(235.957)
Insgesamt	1.906.675	(235.957)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Citibank NA	1.408	(1.408)	-	-	(2.055)	1.408	-	(647)
Goldman Sachs International	16.405	(16.405)	-	-	(203.177)	16.405	-	(186.772)
HSBC Bank Plc	-	-	-	-	(27.498)	-	-	(27.498)
UBS AG	1.856.149	(3.024)	-	1.853.125	(3.024)	3.024	-	-
Westpac Banking Corp	32.713	(203)	-	32.510	(203)	203	-	-
Insgesamt	1.906.675	(21.040)	-	1.885.635	(235.957)	21.040	-	(214.917)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	853.222	(134.345)
Insgesamt	853.222	(134.345)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	8.040	(1.385)	-	6.655	(1.385)	1.385	-	-
JPMorgan Chase Bank	-	-	-	-	(713)	-	-	(713)
UBS AG	-	-	-	-	(3.614)	-	-	(3.614)
Westpac Banking Corp	845.182	(128.633)	-	716.549	(128.633)	128.633	-	-
Insgesamt	853.222	(130.018)	-	723.204	(134.345)	130.018	-	(4.327)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	8.781.301	(2.051.066)
Insgesamt	8.781.301	(2.051.066)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Citibank NA	117.098	(88.311)	-	28.787	(88.311)	88.311	-	-
Standard Chartered Bank	8.367.376	(1.499.461)	-	6.867.915	(1.499.461)	1.499.461	-	-
State Street Bank and Trust Co	116.450	(29.672)	-	86.778	(29.672)	29.672	-	-
Westpac Banking Corp	180.377	(180.377)	-	-	(433.622)	180.377	-	(253.245)
Insgesamt	8.781.301	(1.797.821)	-	6.983.480	(2.051.066)	1.797.821	-	(253.245)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2] (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	1.237.337	(862.058)
Insgesamt	1.237.337	(862.058)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
JPMorgan Chase Bank	-	-	-	-	(18.613)	-	-	(18.613)
Standard Chartered Bank	-	-	-	-	(832.685)	-	-	(832.685)
State Street Bank and Trust Co	-	-	-	-	(3.534)	-	-	(3.534)
Westpac Banking Corp	1.237.337	(7.226)	-	1.230.111	(7.226)	7.226	-	-
Insgesamt	1.237.337	(7.226)	-	1.230.111	(862.058)	7.226	-	(854.832)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Tactical Macro[1]

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	67.331	(36.811)
OTC-Optionen	81.790	(81.790)
Insgesamt	149.121	(118.601)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Brutto-beträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlich-keiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Brutto-beträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Goldman Sachs International	149.121	(118.601)	-	30.520	(118.601)	118.601	-	-
Insgesamt	149.121	(118.601)	-	30.520	(118.601)	118.601	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte EUR	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten EUR
Devisenterminkontrakte	235.719	(2.512.078)
Insgesamt	235.719	(2.512.078)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR	Erhaltene Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten[a] EUR	Nettobetrag[b] EUR
Goldman Sachs International	1.594	(1.594)	-	-	(42.515)	1.594	-	(40.921)
Westpac Banking Corp	234.125	(234.125)	-	-	(2.469.563)	234.125	-	(2.235.438)
Insgesamt	235.719	(235.719)	-	-	(2.512.078)	235.719	-	(2.276.359)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte EUR	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten EUR
Devisenterminkontrakte	232.108	(6.570.781)
Insgesamt	232.108	(6.570.781)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten EUR	Erhaltene Sicherheiten[(a)] EUR	Nettobetrag[(b)] EUR	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge EUR	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte EUR	Verpfändete Sicherheiten[(a)] EUR	Nettobetrag[(b)] EUR
Goldman Sachs International	3.596	(3.596)	-	-	(44.332)	3.596	-	(40.736)
Westpac Banking Corp	228.512	(228.512)	-	-	(6.526.449)	228.512	-	(6.297.937)
Insgesamt	232.108	(232.108)	-	-	(6.570.781)	232.108	-	(6.338.673)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	91.871.867	(53.084.382)
OTC-Optionen	207.424.442	(356.216.715)
OTC-Kontrakt	134.147.954	(36.578.579)
OTC Swaptions	40.202	(29.043)
Insgesamt	433.484.465	(445.908.719)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Barclays Bank Plc	268.757	(60.423)	-	208.334	(60.423)	60.423	-	-
Bank of America Merrill Lynch	4.895.611	(4.895.611)	-	-	(5.073.462)	4.895.611	177.851	-
BNP Paribas	13.781.080	(3.460.943)	-	10.320.137	(3.460.943)	3.460.943	-	-
Citibank NA	3.965.367	(848.919)	-	3.116.448	(848.919)	848.919	-	-
Daiwa	1.777.376	-	-	1.777.376	-	-	-	-
Deutsche Bank AG	57.980	(57.980)	-	-	(68.611)	57.980	-	(10.631)
Goldman Sachs International	165.131.686	(165.131.686)	-	-	(188.950.111)	165.131.686	-	(23.818.425)
HSBC Bank Plc	1.687.310	(1.687.310)	-	-	(3.179.642)	1.687.310	-	(1.492.332)
JPMorgan Chase Bank	67.750.448	(67.750.448)	-	-	(204.346.512)	67.750.448	-	(136.596.064)
Morgan Stanley	11.818.255	(11.818.255)	-	-	(15.261.190)	11.818.255	3.442.935	-
Nomura	38.780.664	(2.711.483)	-	36.069.181	(2.711.483)	2.711.483	-	-
Royal Bank of Scotland	29.607	(13.466)	-	16.141	(13.466)	13.466	-	-
SMBC Nikko Capital Markets Ltd	1.726.344	-	-	1.726.344	-	-	-	-
Société Générale	50.986.074	(773.632)	-	50.212.442	(773.632)	773.632	-	-
State Street Bank and Trust Co	1.726.917	(1.469.262)	-	257.655	(1.469.262)	1.469.262	-	-
UBS AG	65.878.290	(2.623.895)	-	63.254.395	(2.623.895)	2.623.895	-	-
Westpac Banking Corp	3.222.699	(3.222.699)	-	-	(17.067.168)	3.222.699	-	(13.844.469)
Insgesamt	433.484.465	(266.526.012)	-	166.958.453	(445.908.719)	266.526.012	3.620.786	(175.761.921)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	212.294.005	(37.812.332)
OTC-Kontrakt	135.115.207	(73.650.446)
OTC-Optionen	131.345.140	(284.967.910)
OTC Swaptions	1.388.392	(708.024)
Insgesamt	480.142.744	(397.138.712)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Barclays Bank Plc	131	-	-	131	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	25.332.023	(12.164.030)	-	13.167.993	(12.164.030)	12.164.030	-	-
BNP Paribas	25.173.420	(770.244)	(5.000)	24.398.176	(770.244)	770.244	-	-
Citibank NA	969.403	(127.806)	(110.000)	731.597	(127.806)	127.806	-	-
Daiwa	21.787	-	-	21.787	-	-	-	-
Deutsche Bank AG	263.885	(263.885)	-	-	(274.819)	263.885	-	(10.934)
Goldman Sachs International	65.259.726	(48.888.862)	-	16.370.864	(48.888.862)	48.888.862	-	-
JPMorgan Chase Bank	131.590.229	(131.590.229)	-	-	(294.012.216)	131.590.229	162.421.987	-
Morgan Stanley	24.129.157	(24.129.157)	-	-	(27.235.440)	24.129.157	3.106.283	-
Nomura International	7.243.522	(130.072)	-	7.113.450	(130.072)	130.072	-	-
Royal Bank of Canada	65.198	(3.929)	-	61.269	(3.929)	3.929	-	-
Royal Bank of Scotland	385.989	(103.346)	-	282.643	(103.346)	103.346	-	-
SMBC Nikko Capital Markets Ltd	1.202.717	-	-	1.202.717	-	-	-	-
Société Générale	10.320.647	(2.854.549)	-	7.466.098	(2.854.549)	2.854.549	-	-
State Street Bank and Trust Co	140.078.733	(2.627.400)	-	137.451.333	(2.627.400)	2.627.400	-	-
UBS AG	23.625.469	(2.801.808)	-	20.823.661	(2.801.808)	2.801.808	-	-
Westpac Banking Corp	24.480.708	(5.144.191)	-	19.336.517	(5.144.191)	5.144.191	-	-
Insgesamt	480.142.744	(231.599.508)	(115.000)	248.428.236	(397.138.712)	231.599.508	165.528.270	(10.934)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Trading[2*]

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	54.485.356	(6.317.151)
OTC-Kontrakt	17.299.613	(5.597.643)
OTC-Optionen	20.845.166	(36.846.895)
OTC Swaptions	68.848	(20.738)
Insgesamt	92.698.983	(48.782.427)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Bank of America Merrill Lynch	6.835.857	(6.835.857)	-	-	(7.154.155)	6.835.857	318.298	-
BNP Paribas	710.195	(477.433)	-	232.762	(477.433)	477.433	-	-
Daiwa	334.964	-	-	334.964	-	-	-	-
Goldman Sachs International	3.131.104	(3.131.104)	-	-	(4.054.674)	3.131.104	-	(923.570)
JPMorgan Chase Bank	14.193.789	(14.193.789)	-	-	(34.580.892)	14.193.789	20.387.103	-
Morgan Stanley	222.140	(222.140)	-	-	(227.302)	222.140	-	(5.162)
Nomura International	2.318.816	(42.011)	-	2.276.805	(42.011)	42.011	-	-
SMBC Nikko Capital Markets Ltd	1.907.956	-	-	1.907.956	-	-	-	-
Société Générale	8.370.879	(1.230.904)	-	7.139.975	(1.230.904)	1.230.904	-	-
State Street Bank and Trust Co	49.433.338	-	-	49.433.338	-	-	-	-
UBS AG	4.886.978	(509.845)	-	4.377.133	(509.845)	509.845	-	-
Westpac Banking Corp	352.967	(352.967)	-	-	(505.211)	352.967	-	(152.244)
Insgesamt	92.698.983	(26.996.050)	-	65.702.933	(48.782.427)	26.996.050	20.705.401	(1.080.976)

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	1.253.492	(118.963)
Insgesamt	1.253.492	(118.963)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Royal Bank of Canada	103.962	(35.323)	-	68.639	(35.323)	35.323	-	-
UBS AG	1.114.639	(46.969)	-	1.067.670	(46.969)	46.969	-	-
Westpac Banking Corp	34.891	(34.891)	-	-	(36.671)	34.891	-	(1.780)
Insgesamt	1.253.492	(117.183)	-	1.136.309	(118.963)	117.183	-	(1.780)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	2.158.080	(546.931)
Insgesamt	2.158.080	(546.931)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Royal Bank of Canada	70.555	(70.555)	-	-	(140.295)	70.555	-	(69.740)
UBS AG	98.971	(35.034)	-	63.937	(35.034)	35.034	-	-
Westpac Banking Corp	1.988.554	(371.602)	-	1.616.952	(371.602)	371.602	-	-
Insgesamt	2.158.080	(477.191)	-	1.680.889	(546.931)	477.191	-	(69.740)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	12.128.805	(538.104)
Insgesamt	12.128.805	(538.104)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Goldman Sachs International	92.390	(92.390)	-	-	(278.135)	92.390	-	(185.745)
Westpac Banking Corp	12.036.415	(259.969)	-	11.776.446	(259.969)	259.969	-	-
Insgesamt	12.128.805	(352.359)	-	11.776.446	(538.104)	352.359	-	(185.745)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Equity Index PutWrite (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	16.592.327	(1.350.871)
Insgesamt	16.592.327	(1.350.871)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	177.418	(177.418)	-	-	(408.941)	177.418	-	(231.523)
Westpac Banking Corp	16.414.909	(941.930)	-	15.472.979	(941.930)	941.930	-	-
Insgesamt	16.592.327	(1.119.348)	-	15.472.979	(1.350.871)	1.119.348	-	(231.523)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	1.119.012	(115.827)
Insgesamt	1.119.012	(115.827)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Standard Chartered Bank	1.032.749	(35.893)	-	996.856	(35.893)	35.893	-	-
Westpac Banking Corp	86.263	(79.934)	-	6.329	(79.934)	79.934	-	-
Insgesamt	1.119.012	(115.827)	-	1.003.185	(115.827)	115.827	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	973.737	(102.612)
Insgesamt	973.737	(102.612)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
JPMorgan Chase Bank	276.563	(8.511)	-	268.052	(8.511)	8.511	-	-
Standard Chartered Bank	253.879	(10.265)	-	243.614	(10.265)	10.265	-	-
Westpac Banking Corp	443.295	(83.836)	-	359.459	(83.836)	83.836	-	-
Insgesamt	973.737	(102.612)	-	871.125	(102.612)	102.612	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	3.283.704	(342.870)
OTC-Kontrakt	624.429	(7.376.089)
Insgesamt	3.908.133	(7.718.959)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Citibank NA	59.547	(41.584)	-	17.963	(41.584)	41.584	-	-
Goldman Sachs International	544.502	(544.502)	-	-	(4.944.489)	544.502	4.399.987	-
JPMorgan Chase Bank	60.931	(60.931)	-	-	(2.392.877)	60.931	2.331.946	-
UBS AG	1.621.720	(80.607)	-	1.541.113	(80.607)	80.607	-	-
Westpac Banking Corp	1.621.433	(259.402)	-	1.362.031	(259.402)	259.402	-	-
Insgesamt	3.908.133	(987.026)	-	2.921.107	(7.718.959)	987.026	6.731.933	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	6.686.844	(822.791)
OTC-Kontrakt	3.827.134	(1.992.712)
Insgesamt	10.513.978	(2.815.503)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	3.014.864	(1.622.276)	-	1.392.588	(1.622.276)	1.622.276	-	-
JPMorgan Chase Bank	871.513	(372.750)	-	498.763	(372.750)	372.750	-	-
UBS AG	35.400	(35.400)	-	-	(76.976)	35.400	-	(41.576)
Westpac Banking Corp	6.592.201	(743.501)	-	5.848.700	(743.501)	743.501	-	-
Insgesamt	10.513.978	(2.773.927)	-	7.740.051	(2.815.503)	2.773.927	-	(41.576)

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	1.843.892	(325.170)
Insgesamt	1.843.892	(325.170)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	1.114.025	(44.932)	-	1.069.093	(44.932)	44.932	-	-
UBS AG	178.194	(24.196)	-	153.998	(24.196)	24.196	-	-
Westpac Banking Corp	551.673	(256.042)	-	295.631	(256.042)	256.042	-	-
Insgesamt	1.843.892	(325.170)	-	1.518.722	(325.170)	325.170	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	2.736.142	(587.402)
Insgesamt	2.736.142	(587.402)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	678.594	(86.777)	-	591.817	(86.777)	86.777	-	-
UBS AG	103.906	(68.135)	-	35.771	(68.135)	68.135	-	-
Westpac Banking Corp	1.953.642	(432.490)	-	1.521.152	(432.490)	432.490	-	-
Insgesamt	2.736.142	(587.402)	-	2.148.740	(587.402)	587.402	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	2.358.847	(441.683)
Insgesamt	2.358.847	(441.683)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[(a)] US$	Nettobetrag[(b)] US$
Goldman Sachs International	935.666	(123.497)	-	812.169	(123.497)	123.497	-	-
UBS AG	321.901	(132.714)	-	189.187	(132.714)	132.714	-	-
Westpac Banking Corp	1.101.280	(185.472)	-	915.808	(185.472)	185.472	-	-
Insgesamt	2.358.847	(441.683)	-	1.917.164	(441.683)	441.683	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	4.089.640	(1.230.032)
Insgesamt	4.089.640	(1.230.032)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	1.575.053	(296.037)	-	1.279.016	(296.037)	296.037	-	-
UBS AG	112.854	(41.658)	-	71.196	(41.658)	41.658	-	-
Westpac Banking Corp	2.401.733	(892.337)	-	1.509.396	(892.337)	892.337	-	-
Insgesamt	4.089.640	(1.230.032)	-	2.859.608	(1.230.032)	1.230.032	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	747.370	(137.144)
Insgesamt	747.370	(137.144)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	110.085	(31.210)	-	78.875	(31.210)	31.210	-	-
UBS AG	209.485	(22.829)	-	186.656	(22.829)	22.829	-	-
Westpac Banking Corp	427.800	(83.105)	-	344.695	(83.105)	83.105	-	-
Insgesamt	747.370	(137.144)	-	610.226	(137.144)	137.144	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)

31. Dezember 2022

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	949.457	(236.699)
Insgesamt	949.457	(236.699)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Goldman Sachs International	186.760	(54.952)	-	131.808	(54.952)	54.952	-	-
UBS AG	17.959	(7.319)	-	10.640	(7.319)	7.319	-	-
Westpac Banking Corp	744.738	(174.428)	-	570.310	(174.428)	174.428	-	-
Insgesamt	949.457	(236.699)	-	712.758	(236.699)	236.699	-	-

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

26. SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN (FORTSETZUNG)

US Small Cap Intrinsic Value

31. Dezember 2023

Beschreibung	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Vermögenswerte US$	Bruttobeträge der in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ausgewiesenen Verbindlichkeiten US$
Devisenterminkontrakte	-	(398)
Insgesamt	-	(398)

Nicht in der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldierte Beträge:

	Vermögenswerte				Verbindlichkeiten			
Gegenpartei	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Verbindlichkeiten US$	Erhaltene Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$	In der Aufstellung der Vermögens-werte und Verbindlichkeiten ausgewiesene Bruttobeträge US$	Zur Saldierung verfügbare Vermögenswerte US$	Verpfändete Sicherheiten[a] US$	Nettobetrag[b] US$
Brown Brothers Harriman	-	-	-	-	(398)	-	-	(398)
Insgesamt	-	-	-	-	(398)	-	-	(398)

31. Dezember 2022

Keine zur Saldierung verfügbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten aus OTC-Derivaten und Wertpapierleihgeschäften.

(a) Die erhaltenen (oder verpfändeten) Sicherheiten sind auf einen Betrag begrenzt, der 100 % des Nettobetrags der Vermögenswerte (oder Verbindlichkeiten) in den oben dargestellten Tabellen für die jeweilige Gegenpartei nicht überschreiten darf.
(b) Ein Nettobetrag größer als null entspricht den Beträgen, die bei einem Ausfall einer Gegenpartei zum 31. Dezember 2023 einem Verlust unterliegen. Ein Nettobetrag kleiner als null entspricht für jede Gegenpartei unterbesicherte Beträge zum 31. Dezember 2023.

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.
[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

FÜR DAS AM 31. DEZEMBER 2023 BEENDETE GESCHÄFTSJAHR

27. GESCHLOSSENE FONDS

Neben den in diesem Bericht aufgeführten Fonds gibt es eine Reihe geschlossener Teilfonds, deren Zulassung noch nicht zurückgenommen wurde.
Eine vollständige Liste dieser Fonds ist nachstehend angegeben. Am Ende des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2023 hielt einer dieser Teilfonds, der Lehman Brothers Commodity Plus Fund, einen Betrag in Höhe von 1,93 Mio. US$ (31. Dezember 2022: 1,84 Mio. US$) auf einem Konto bei der Verwahrstelle in Zusammenhang mit einem noch nicht beigelegten Rechtsstreit hinsichtlich einer Derivate-Transaktion.

- Lehman Brothers Global Value Fund
- Lehman Brothers USA Value Fund
- Lehman Brothers European Value Fund
- Lehman Brothers Global Bond Fund
- Lehman Brothers Commodity Plus Fund
- Lehman Brothers Alpha Select 2 Fund
- Lehman Brothers Alpha Select 4 Fund

Anhang I

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT)

Für das zum 31. Dezember 2023 endende Geschäftsjahr basieren die Gesamtkostenquoten („TERs") auf die den angegebenen Daten vorangegangenen zwölf Monate.

31. Dezember 2023

5G Connectivity

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse AUD A	1,82 %	1,82 %
Thesaurierende Klasse AUD I2	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,83 %	1,83 %
Thesaurierende Klasse CHF I	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,82 %	0,82 %
Thesaurierende Klasse CNY A	1,82 %	1,82 %
Thesaurierende Klasse CNY I2	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,82 %	1,82 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,82 %	1,82 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,97 %	0,97 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,97 %	0,97 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	2,62 %	2,62 %
Thesaurierende Klasse GBP A	1,82 %	1,82 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,96 %	0,96 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse HKD A	1,82 %	1,82 %
Thesaurierende Klasse HKD I2	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,82 %	1,82 %
Thesaurierende Klasse SGD I2	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,82 %	1,82 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,92 %	2,92 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,97 %	0,97 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,97 %	0,97 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,71 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,62 %	2,62 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,12 %	0,12 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

5G Connectivity (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse ZAR A	1,81 %	1,81 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,93 %	2,93 %

China A-Share Equity

Thesaurierende Klasse CNY I	7,60 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	7,59 %	1,20 %
Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	7,60 %	1,20 %

China Bond

Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,65 %	1,50 %
Ausschüttende Klasse CNY I	1,01 %	0,85 %
Thesaurierende Klasse CNY Z	0,36 %	0,20 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,88 %	0,72 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert)	1,65 %	1,50 %
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	1,00 %	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,36 %	0,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	0,36 %	0,20 %

China Equity

Thesaurierende Klasse CHF I	1,27 %	1,27 %
Thesaurierende Klasse EUR A	2,02 %	2,02 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,27 %	1,27 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,16 %	0,16 %
Ausschüttende Klasse GBP A	2,01 %	2,01 %
Thesaurierende Klasse SGD A	2,02 %	2,02 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,02 %	2,02 %
Ausschüttende Klasse USD A	2,02 %	2,02 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,27 %	1,27 %
Thesaurierende Klasse USD I2	1,06 %	1,06 %
Thesaurierende Klasse USD M	3,01 %	3,01 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,62 %	1,62 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,17 %	0,17 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Climate Innovation[1]

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD A	6,45 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse USD I	5,59 %	1,05 %
Thesaurierende Klasse USD I5	5,16 %	0,63 %
Thesaurierende Klasse USD Z	4,76 %	0,20 %

CLO Income

Thesaurierende Klasse EUR A	1,66 %	1,66 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,93 %	0,93 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,76 %	0,76 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,17 %	0,17 %
Thesaurierende Klasse SEK I	0,92 %	0,92 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,67 %	1,67 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,94 %	0,94 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,96 %	0,96 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,77 %	0,77 %
Ausschüttende Klasse USD I5	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,17 %	0,17 %

Commodities[2]

Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,92 %	0,85 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,56 %	0,53 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,62 %	1,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,88 %	0,85 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,55 %	0,53 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,23 %	2,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,23 %	0,20 %

Corporate Hybrid Bond

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,28 %	1,28 %
Thesaurierende Klasse CHF P	0,64 %	0,64 %
Ausschüttende Klasse CHF P	0,65 %	0,65 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,28 %	1,28 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,28 %	1,28 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,68 %	0,68 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,68 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,56 %	0,56 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,56 %	0,56 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,50 %	0,50 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,38 %	0,38 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,88 %	1,88 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,88 %	1,88 %
Thesaurierende Klasse EUR P	0,65 %	0,65 %
Ausschüttende Klasse EUR P	0,65 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,68 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,56 %	0,56 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,65 %	0,65 %
Ausschüttende Klasse GBP P	0,65 %	0,65 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,28 %	1,28 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,28 %	1,28 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,28 %	1,28 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,27 %	1,27 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,28 %	2,28 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,68 %	0,68 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,68 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,56 %	0,56 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,56 %	0,56 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,88 %	1,88 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,88 %	1,88 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,65 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,08 %	0,08 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Developed Market FMP – 2027[1]

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse EUR A	0,79 %	0,79 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,40 %	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD A	0,78 %	0,78 %
Ausschüttende Klasse USD A	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,44 %	0,44 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,41 %	0,41 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,52 %	0,52 %
Ausschüttende Klasse USD X	0,58 %	0,55 %

Emerging Market Debt - Hard Currency

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,49 %	1,49 %
Ausschüttende Klasse AUD I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)	0,58 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,65 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse CHF P	0,76 %	0,76 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,79 %	0,79 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,65 %	0,65 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,65 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,58 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,51 %	0,51 %
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,44 %	0,44 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,29 %	2,29 %
Ausschüttende Klasse EUR M	2,29 %	2,29 %
Thesaurierende Klasse EUR P	0,76 %	0,76 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,09 %	0,09 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,79 %	0,79 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,65 %	0,65 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,65 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,76 %	0,76 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse SEK I2	0,65 %	0,65 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,49 %	1,49 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,49 %	1,49 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,49 %	1,49 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,49 %	2,49 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,79 %	0,79 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,79 %	0,79 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,66 %	0,66 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,66 %	0,66 %
Ausschüttende Klasse USD I3	0,58 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,29 %	2,29 %
Ausschüttende Klasse USD M	2,29 %	2,29 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,76 %	0,76 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,51 %	0,51 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,09 %	0,09 %

Emerging Market Debt - Local Currency

Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse AUD B	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse AUD C2	2,90 %	2,90 %
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse AUD E	2,98 %	2,98 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,98 %	1,98 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,98 %	1,98 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,67 %	1,67 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,93 %	0,93 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,93 %	0,93 %
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	0,78 %	0,78 %
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,63 %	0,63 %
Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,94 %	0,94 %
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,63 %	0,63 %
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,63 %	0,63 %
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	0,54 %	0,54 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,68 %	1,68 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,68 %	1,68 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,68 %	1,68 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,68 %	1,68 %
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse USD B	2,97 %	2,97 %
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	2,98 %	2,98 %
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,98 %	2,98 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,93 %	0,93 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,93 %	0,93 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,93 %	0,93 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,78 %	0,78 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,54 %	0,54 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,98 %	1,98 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,98 %	1,98 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,55 %	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD Y	0,54 %	0,54 %
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	2,98 %	2,98 %
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	2,97 %	2,97 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	2,95 %	2,95 %
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,97 %	2,97 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,98 %	1,98 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,98 %	1,98 %

Emerging Market Debt Blend

Ausschüttende Klasse AUD I3	0,69 %	0,69 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,60 %	1,60 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,90 %	0,90 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,90 %	0,90 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,76 %	0,76 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,76 %	0,76 %
Ausschüttende Klasse EUR I3	0,69 %	0,69 %
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,62 %	0,62 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,40 %	2,40 %
Ausschüttende Klasse EUR M	2,41 %	2,40 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,20 %	0,20 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,90 %	0,90 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,84 %	0,84 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,90 %	0,90 %
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,90 %	0,90 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,87 %	0,87 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,87 %	0,87 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,20 %	0,20 %
Thesaurierende Klasse NOK U	1,25 %	1,25 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,60 %	1,60 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,60 %	1,60 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,60 %	1,60 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,60 %	1,60 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,60 %	2,60 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,90 %	0,90 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,90 %	0,90 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,76 %	0,76 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD I5	0,56 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,40 %	2,40 %
Ausschüttende Klasse USD M	2,40 %	2,40 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,20 %	0,20 %

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend

Thesaurierende Klasse AUD I2	0,93 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse NOK I	1,03 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse NOK I3	0,97 %	0,62 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,05 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,93 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,45 %	0,20 %

Emerging Markets Equity

Thesaurierende Klasse AUD B	3,50 %	3,30 %
Thesaurierende Klasse AUD C2	3,50 %	3,30 %
Thesaurierende Klasse AUD E	3,49 %	3,30 %
Thesaurierende Klasse AUD T	2,51 %	2,30 %
Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)	1,51 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse CAD I2	1,31 %	1,10 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,49 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse EUR M	3,51 %	3,30 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,51 %	0,30 %
Thesaurierende Klasse GBP I	1,51 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,51 %	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,51 %	2,30 %
Thesaurierende Klasse USD B	3,50 %	3,30 %
Thesaurierende Klasse USD C2	3,43 %	3,30 %
Thesaurierende Klasse USD E	3,50 %	3,30 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,48 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse USD M	3,50 %	3,30 %
Thesaurierende Klasse USD T	2,48 %	2,30 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,51 %	0,30 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Emerging Markets Equity (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse ZAR B	3,51 %	3,30 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	3,38 %	3,30 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	3,51 %	3,30 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	2,51 %	2,30 %

Euro Bond

Thesaurierende Klasse EUR I	1,83 %	0,55 %
Ausschüttende Klasse EUR I	1,71 %	0,55 %

Euro Bond Absolute Return

Thesaurierende Klasse EUR I	0,85 %	0,65 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,87 %	0,65 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,60 %	0,43 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,40 %	0,20 %

European High Yield Bond

Thesaurierende Klasse CHF I	0,85 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,83 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,67 %	0,67 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,10 %	2,00 %
Thesaurierende Klasse EUR X	0,46 %	0,40 %
Thesaurierende Klasse EUR Y	0,31 %	0,30 %
Ausschüttende Klasse EUR Y	0,32 %	0,30 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,51 %	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,91 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,54 %	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,33 %	0,20 %

European Sustainable Equity

Ausschüttende Klasse EUR A	1,63 %	1,63 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,74 %	0,74 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

European Sustainable Equity (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse EUR I	0,71 %	0,71 %
Ausschüttende Klasse EUR I3	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,44 %	0,44 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,44 %	2,44 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,14 %	0,14 %
Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)	1,62 %	1,62 %
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	0,71 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)	2,42 %	2,42 %

Event Driven[2]

Thesaurierende Klasse EUR I	1,27 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,80 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I5	0,79 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse GBP P	1,24 %	1,15 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,34 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,79 %	0,70 %

Global Bond

Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,01 %	0,95 %
Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	0,62 %	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD C1	1,68 %	1,60 %
Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	0,43 %	0,35 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,52 %	0,40 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,10 %	1,00 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,03 %	0,95 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,28 %	0,20 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,01 %	0,95 %

Global Diversified Income FMP – 2024

Thesaurierende Klasse EUR A	0,90 %	0,90 %
Ausschüttende Klasse EUR A	0,90 %	0,90 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,50 %	0,50 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Global Diversified Income FMP – 2024 (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse GBP I	0,50 %	0,50 %
Ausschüttende Klasse HKD A	0,90 %	0,90 %
Ausschüttende Klasse SGD A	0,90 %	0,90 %
Thesaurierende Klasse USD A	0,90 %	0,90 %
Ausschüttende Klasse USD A	0,90 %	0,90 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,50 %	0,50 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,50 %	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,55 %	0,55 %
Ausschüttende Klasse USD X	0,55 %	0,55 %

Global Equity Megatrends

Thesaurierende Klasse EUR I	1,02 %	1,02 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	2,73 %	2,73 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	1,04 %	1,04 %
Thesaurierende Klasse SGD A	2,10 %	2,00 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,93 %	1,93 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,08 %	1,08 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,73 %	2,73 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,23 %	0,23 %

Global Flexible Credit Income

Thesaurierende Klasse CAD I5	0,41 %	0,41 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,71 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,11 %	2,11 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,41 %	0,41 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,31 %	1,31 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,71 %	0,71 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,71 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,11 %	2,11 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,11 %	0,11 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Global SDG Engagement

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse AUD I	0,73 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse CHF I4	0,50 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse CHF I4	0,50 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse CHF X	1,22 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,50 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse EUR I4	0,50 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse EUR X	1,22 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)	0,23 %	0,20 %
Thesaurierende Klasse GBP I4	0,50 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse GBP X	1,22 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,33 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,74 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,50 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,93 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,20 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,13 %	0,10 %

Global Investment Grade Credit

Thesaurierende Klasse EUR I	0,51 %	0,45 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,51 %	0,45 %
Thesaurierende Klasse USD X	0,31 %	0,25 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,19 %	0,15 %

Global Opportunistic Bond

Thesaurierende Klasse EUR I	0,69 %	0,50 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,76 %	0,48 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,01 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,77 %	0,50 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,78 %	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,71 %	0,44 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,47 %	0,20 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Global Real Estate Securities

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse EUR M	3,24 %	2,80 %
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	0,83 %	0,30 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,76 %	0,30 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,24 %	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD CI	3,26 %	2,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,48 %	1,05 %
Ausschüttende Klasse USD I5	1,02 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD M	3,26 %	2,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,76 %	0,30 %

Global Sustainable Equity

Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,46 %	0,46 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	2,47 %	2,47 %
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	0,16 %	0,16 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,77 %	0,77 %
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	0,46 %	0,46 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,66 %	1,66 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,76 %	0,76 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,75 %	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,46 %	2,46 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,16 %	0,16 %

Global Sustainable Value

Thesaurierende Klasse EUR M	2,18 %	2,00 %
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	0,69 %	0,52 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,88 %	0,73 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,38 %	1,20 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,93 %	0,75 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,79 %	0,62 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,48 %	0,30 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

High Yield Bond

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,31 %	1,31 %
Thesaurierende Klasse AUD A	1,31 %	1,31 %
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	2,91 %	2,91 %
Thesaurierende Klasse AUD B	2,91 %	2,91 %
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	2,91 %	2,91 %
Thesaurierende Klasse AUD E	2,91 %	2,91 %
Ausschüttende Klasse AUD I	0,71 %	0,71 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,91 %	1,91 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	1,91 %	1,91 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,91 %	1,91 %
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	1,31 %	1,31 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,31 %	1,31 %
Thesaurierende Klasse CHF I	0,70 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,31 %	1,31 %
Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,31 %	1,31 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,31 %	1,31 %
Ausschüttende Klasse EUR A	1,31 %	1,31 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,71 %	0,71 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,71 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,61 %	0,61 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,91 %	1,91 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,11 %	0,11 %
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	1,31 %	1,31 %
Thesaurierende Klasse GBP A	1,31 %	1,31 %
Ausschüttende Klasse GBP A	1,31 %	1,31 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,71 %	0,71 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,71 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,61 %	0,61 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

High Yield Bond (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,61 %	0,61 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,11 %	0,11 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,31 %	1,31 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,29 %	1,29 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,31 %	1,31 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,31 %	1,31 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,31 %	1,31 %
Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)	1,31 %	1,31 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,31 %	1,31 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,31 %	1,31 %
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	2,91 %	2,91 %
Thesaurierende Klasse USD B	2,91 %	2,91 %
Thesaurierende Klasse USD C	1,91 %	1,91 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,31 %	2,31 %
Ausschüttende Klasse USD C1	2,31 %	2,31 %
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Thesaurierende Klasse USD C2	2,90 %	2,90 %
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	2,91 %	2,91 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,91 %	2,91 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,71 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,71 %	0,71 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,71 %	0,71 %
Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)	0,61 %	0,61 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,91 %	1,91 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,91 %	1,91 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,68 %	0,68 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,91 %	1,91 %
Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)	1,91 %	1,91 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,91 %	1,91 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

High Yield Bond (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)	1,01 %	1,01 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,01 %	1,01 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,11 %	0,11 %
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	2,91 %	2,91 %
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	2,90 %	2,90 %
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	2,91 %	2,91 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,91 %	2,91 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,91 %	1,91 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,91 %	1,91 %

InnovAsia 5G

Thesaurierende Klasse CHF I4	1,58 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse EUR A	2,99 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	1,60 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	3,56 %	2,70 %
Thesaurierende Klasse EUR X	2,51 %	1,65 %
Thesaurierende Klasse SGD A	2,76 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse SGD I4	1,57 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse SGD X	2,51 %	1,65 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,46 %	1,90 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,85 %	1,05 %
Thesaurierende Klasse USD I4	1,61 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse USD M	3,56 %	2,70 %
Thesaurierende Klasse USD X	2,57 %	1,65 %

Japan Equity Engagement

Ausschüttende Klasse EUR I5	0,56 %	0,56 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	0,60 %	0,60 %
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	0,67 %	0,67 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	1,06 %	1,06 %
Thesaurierende Klasse JPY I	1,03 %	1,03 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,98 %	0,98 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Japan Equity Engagement (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse JPY I5	0,61 %	0,61 %
Thesaurierende Klasse JPY Z	0,16 %	0,16 %

Macro Opportunities FX

Thesaurierende Klasse EUR I	2,53 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	1,23 %	0,20 %
Thesaurierende Klasse SEK I	1,39 %	0,80 %
Ausschüttende Klasse SEK I	1,96 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	2,43 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,58 %	0,20 %

Next Generation Mobility

Thesaurierende Klasse EUR A	1,88 %	1,88 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,02 %	1,02 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	1,03 %	1,03 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	2,68 %	2,68 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,88 %	1,88 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,88 %	2,88 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,03 %	1,03 %
Ausschüttende Klasse USD I	1,03 %	1,03 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,68 %	2,68 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,73 %	1,73 %

Next Generation Space Economy[2]

Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	1,48 %	0,80 %
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	3,33 %	2,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,79 %	1,05 %

Responsible Asian Debt – Hard Currency

Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,78 %	1,35 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Responsible Asian Debt – Hard Currency (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD A	1,78 %	1,35 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,79 %	2,35 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,19 %	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD I	1,28 %	0,75 %
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	0,96 %	0,51 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,95 %	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,37 %	1,95 %
Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	1,70 %	1,25 %
Thesaurierende Klasse USD X	1,68 %	1,25 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,53 %	0,15 %

Short Duration Emerging Market Debt

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,07 %	1,07 %
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	1,07 %	1,07 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,07 %	1,07 %
Ausschüttende Klasse CHF A	1,07 %	1,07 %
Thesaurierende Klasse CHF I	0,57 %	0,57 %
Ausschüttende Klasse CHF I	0,57 %	0,57 %
Thesaurierende Klasse CHF I2	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse CHF I2	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse CHF I5	0,32 %	0,32 %
Thesaurierende Klasse CHF P	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,07 %	1,07 %
Ausschüttende Klasse EUR A	1,07 %	1,07 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,57 %	0,57 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,57 %	0,57 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse EUR I2	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,32 %	0,32 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,67 %	1,67 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,68 %	1,68 %
Thesaurierende Klasse EUR P	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse EUR U	0,82 %	0,82 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse EUR X	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse GBP A	1,07 %	1,07 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,57 %	0,57 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,57 %	0,57 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse GBP I5	0,33 %	0,33 %
Thesaurierende Klasse GBP P	0,56 %	0,56 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,57 %	0,57 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,57 %	0,57 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,07 %	1,07 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,08 %	1,08 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,08 %	1,08 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,07 %	1,07 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,07 %	1,07 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,07 %	2,07 %
Ausschüttende Klasse USD C1	2,07 %	2,07 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,57 %	0,57 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,58 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,47 %	0,47 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,32 %	0,32 %
Ausschüttende Klasse USD I5	0,32 %	0,32 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,67 %	1,67 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,67 %	1,67 %
Thesaurierende Klasse USD P	0,55 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,08 %	0,08 %

Short Duration High Yield SDG Engagement

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,32 %	1,32 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,32 %	1,32 %
Thesaurierende Klasse CHF I	0,72 %	0,72 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Short Duration High Yield SDG Engagement (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,32 %	1,32 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,32 %	1,32 %
Ausschüttende Klasse EUR A	1,32 %	1,32 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,72 %	0,72 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,62 %	0,62 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,92 %	1,92 %
Ausschüttende Klasse EUR M	1,92 %	1,92 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,73 %	0,73 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	0,62 %	0,62 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	0,62 %	0,62 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,32 %	1,32 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,72 %	0,72 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,72 %	0,72 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,32 %	1,32 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,32 %	1,32 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,32 %	1,32 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,32 %	1,32 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,32 %	2,32 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,72 %	0,72 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,73 %	0,73 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,60 %	0,60 %
Ausschüttende Klasse USD I2	0,61 %	0,61 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,49 %	0,49 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,42 %	0,42 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,91 %	1,91 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,91 %	1,91 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,12 %	0,12 %

Strategic Income

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)	0,11 %	0,11 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Strategic Income (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	1,13 %	1,13 %
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,60 %	0,60 %
Thesaurierende Klasse EUR M	1,71 %	1,71 %
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)	0,66 %	0,66 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse JPY I	0,61 %	0,61 %
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse JPY I CG	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,60 %	0,60 %
Thesaurierende Klasse JPY Z	0,11 %	0,11 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,11 %	1,11 %
Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,11 %	1,11 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,11 %	1,11 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,11 %	2,11 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,61 %	0,61 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,61 %	0,61 %
Thesaurierende Klasse USD M	1,71 %	1,71 %
Ausschüttende Klasse USD M	1,71 %	1,71 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,11 %	0,11 %

Sustainable Asia High Yield

Thesaurierende Klasse EUR X	1,08 %	0,55 %
Thesaurierende Klasse GBP X	1,09 %	0,55 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,87 %	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,87 %	1,40 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,27 %	0,80 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Sustainable Asia High Yield (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD Z	0,67 %	0,20 %
Ausschüttende Klasse USD Z	0,67 %	0,20 %

Sustainable Emerging Market Corporate Debt

Thesaurierende Klasse CHF I	1,14 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,93 %	1,80 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,14 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,82 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,74 %	2,60 %
Ausschüttende Klasse EUR M	2,74 %	2,60 %
Thesaurierende Klasse EUR X	0,80 %	0,58 %
Thesaurierende Klasse GBP I	1,13 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse SEK A	1,94 %	1,80 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,94 %	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,94 %	1,80 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,94 %	2,80 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,14 %	1,00 %
Ausschüttende Klasse USD I	1,14 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,97 %	0,84 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,74 %	2,60 %
Ausschüttende Klasse USD M	2,74 %	2,60 %

Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency[2]

Thesaurierende Klasse EUR I3	0,59 %	0,59 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,51 %	0,51 %
Thesaurierende Klasse EUR X	0,45 %	0,45 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,78 %	0,78 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,45 %	0,45 %

Tactical Macro[1]

Thesaurierende Klasse USD I	1,36 %	1,00 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,91 %	0,60 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,53 %	0,20 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Ultra Short Term Euro Bond

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse CHF P	0,26 %	0,26 %
Thesaurierende Klasse CHF U	0,37 %	0,37 %
Thesaurierende Klasse EUR A	0,46 %	0,46 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,27 %	0,27 %
Ausschüttende Klasse EUR I	0,27 %	0,27 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	0,23 %	0,23 %
Thesaurierende Klasse EUR I5	0,17 %	0,17 %
Thesaurierende Klasse EUR M	0,66 %	0,66 %
Thesaurierende Klasse EUR U	0,37 %	0,37 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,08 %	0,08 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,27 %	0,27 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,08 %	0,08 %

Uncorrelated Strategies

Thesaurierende Klasse CHF I	1,69 %	1,69 %
Thesaurierende Klasse EUR A	2,43 %	2,43 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,65 %	1,65 %
Thesaurierende Klasse EUR I2	1,54 %	1,54 %
Thesaurierende Klasse EUR M	3,24 %	3,24 %
Thesaurierende Klasse EUR P	1,60 %	1,60 %
Thesaurierende Klasse GBP I	1,63 %	1,63 %
Thesaurierende Klasse GBP I2	1,55 %	1,55 %
Ausschüttende Klasse GBP I2	1,59 %	1,56 %
Thesaurierende Klasse GBP I5	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse GBP P	1,66 %	1,66 %
Thesaurierende Klasse GBP Z	0,95 %	0,95 %
Thesaurierende Klasse JPY I	1,70 %	1,70 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,78 %	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,44 %	2,44 %
Thesaurierende Klasse USD C1	3,45 %	3,45 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,70 %	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD I2	1,55 %	1,55 %
Thesaurierende Klasse USD I5	1,33 %	1,33 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD M	3,24 %	3,24 %
Thesaurierende Klasse USD P	1,64 %	1,64 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,94 %	0,94 %

US Equity

Thesaurierende Klasse JPY I3	0,91 %	0,72 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,89 %	1,70 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,14 %	0,95 %
Ausschüttende Klasse USD I	1,14 %	0,95 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,71 %	2,50 %

US Equity Index PutWrite

Thesaurierende Klasse EUR I	0,71 %	0,71 %
Ausschüttende Klasse EUR I3	0,52 %	0,52 %
Thesaurierende Klasse EUR I4	0,46 %	0,46 %
Ausschüttende Klasse EUR I4	0,45 %	0,45 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,10 %	2,10 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,70 %	0,70 %
Thesaurierende Klasse GBP I3	0,52 %	0,52 %
Ausschüttende Klasse GBP I3	0,52 %	0,52 %
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	0,51 %	0,51 %
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,46 %	0,46 %
Ausschüttende Klasse GBP I4	0,47 %	0,47 %
Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,67 %	0,67 %
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	1,30 %	1,30 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,30 %	1,30 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,69 %	0,69 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,70 %	0,70 %
Ausschüttende Klasse USD I3	0,52 %	0,52 %
Thesaurierende Klasse USD I4	0,46 %	0,46 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,10 %	2,10 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,10 %	0,10 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

US Large Cap Value

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse EUR A	1,58 %	1,58 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,57 %	1,57 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,78 %	0,78 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,78 %	0,78 %
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,50 %	0,50 %
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	0,43 %	0,43 %
Thesaurierende Klasse GBP I	0,77 %	0,77 %
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,79 %	0,79 %
Ausschüttende Klasse GBP I	0,79 %	0,79 %
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,78 %	0,78 %
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	0,50 %	0,50 %
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	0,75 %	0,75 %
Ausschüttende Klasse GBP P	0,73 %	0,73 %
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	0,71 %	0,71 %
Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	0,71 %	0,71 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,58 %	1,58 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,78 %	0,78 %
Ausschüttende Klasse USD I4	0,50 %	0,50 %
Thesaurierende Klasse USD I5	0,42 %	0,42 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,37 %	2,37 %
Thesaurierende Klasse USD Y	0,73 %	0,73 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,07 %	0,07 %

US Long Short Equity

Thesaurierende Klasse EUR A	2,43 %	2,43 %
Thesaurierende Klasse EUR I	1,51 %	1,51 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	1,14 %	1,14 %
Thesaurierende Klasse EUR M	3,24 %	3,24 %
Ausschüttende Klasse GBP I3	1,15 %	1,15 %
Thesaurierende Klasse SGD A1	2,04 %	2,04 %
Thesaurierende Klasse USD A (PF)	1,89 %	1,89 %
Thesaurierende Klasse USD A	2,44 %	2,44 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD A1	2,04 %	2,04 %
Ausschüttende Klasse USD I (PF)	1,19 %	1,19 %
Thesaurierende Klasse USD I	1,53 %	1,53 %
Thesaurierende Klasse USD I3	1,13 %	1,13 %
Thesaurierende Klasse USD M	3,24 %	3,24 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,98 %	1,98 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,19 %	0,19 %

US Multi Cap Opportunities

Thesaurierende Klasse AUD E	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,98 %	1,98 %
Thesaurierende Klasse EUR I3	0,68 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,88 %	2,88 %
Thesaurierende Klasse EUR1 A	1,88 %	1,88 %
Thesaurierende Klasse EUR1 I	1,03 %	1,03 %
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	0,67 %	0,67 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,88 %	1,88 %
Thesaurierende Klasse USD B	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,88 %	2,88 %
Thesaurierende Klasse USD C2	2,97 %	2,97 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,84 %	0,84 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,68 %	0,68 %
Ausschüttende Klasse USD I3	0,68 %	0,68 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,88 %	2,88 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,98 %	1,98 %
Thesaurierende Klasse USD U	1,43 %	1,43 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,18 %	0,18 %
Thesaurierende Klasse USD1 A	1,88 %	1,88 %
Thesaurierende Klasse USD1 I	1,03 %	1,03 %
Ausschüttende Klasse USD1 I	1,03 %	1,03 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	2,98 %	2,98 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse ZAR C2	2,96 %	2,96 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,98 %	2,98 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,98 %	1,98 %

US Real Estate Securities

Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	1,70 %	1,70 %
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	2,99 %	2,99 %
Thesaurierende Klasse AUD B	2,99 %	2,99 %
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	2,99 %	2,99 %
Thesaurierende Klasse AUD E	3,00 %	3,00 %
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	1,99 %	1,99 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,99 %	1,99 %
Thesaurierende Klasse CHF A	1,69 %	1,69 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,69 %	1,69 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,94 %	0,94 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,69 %	2,69 %
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	1,69 %	1,69 %
Thesaurierende Klasse SGD A	1,69 %	1,69 %
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	1,69 %	1,69 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,69 %	1,69 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,69 %	1,69 %
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	2,99 %	2,99 %
Thesaurierende Klasse USD B	2,99 %	2,99 %
Thesaurierende Klasse USD C1	2,69 %	2,69 %
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	2,99 %	2,99 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,99 %	2,99 %
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	0,94 %	0,94 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,94 %	0,94 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,94 %	0,94 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,73 %	0,73 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,69 %	2,69 %
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	1,99 %	1,99 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

US Real Estate Securities (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD T	1,99 %	1,99 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,20 %	0,20 %
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	2,99 %	2,99 %
Thesaurierende Klasse ZAR B	2,99 %	2,99 %
Thesaurierende Klasse ZAR C2	2,99 %	2,99 %
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	2,99 %	2,99 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,99 %	2,99 %
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	1,99 %	1,99 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,99 %	1,99 %

US Small Cap

Thesaurierende Klasse AUD B	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse AUD C2	2,88 %	2,88 %
Thesaurierende Klasse AUD E	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse AUD T	1,93 %	1,93 %
Thesaurierende Klasse EUR A	1,83 %	1,83 %
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	1,82 %	1,82 %
Thesaurierende Klasse EUR I	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	0,64 %	0,64 %
Thesaurierende Klasse EUR M	2,83 %	2,83 %
Thesaurierende Klasse EUR Z	0,13 %	0,13 %
Ausschüttende Klasse JPY I	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,83 %	1,83 %
Ausschüttende Klasse USD A	1,83 %	1,83 %
Thesaurierende Klasse USD B	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse USD C2	2,88 %	2,88 %
Thesaurierende Klasse USD E	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,98 %	0,98 %
Ausschüttende Klasse USD I	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse USD I3	0,73 %	0,73 %

Anhang I (Fortsetzung)

GESAMTKOSTENQUOTEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

31. Dezember 2023

US Small Cap (Fortsetzung)

Anteilklasse	Annualisierte TER in % (Ohne Gebührenverzicht)	Annualisierte TER in % (Mit Gebührenverzicht)
Thesaurierende Klasse USD M	2,83 %	2,83 %
Thesaurierende Klasse USD T	1,93 %	1,93 %
Thesaurierende Klasse USD Z	0,13 %	0,13 %
Thesaurierende Klasse ZAR E	2,93 %	2,93 %
Thesaurierende Klasse ZAR T	1,93 %	1,93 %

US Small Cap Intrinsic Value

Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)	0,77 %	0,77 %
Thesaurierende Klasse USD A	1,83 %	1,83 %
Thesaurierende Klasse USD I	0,98 %	0,98 %
Thesaurierende Klasse USD I2	0,81 %	0,81 %
Thesaurierende Klasse USD M	2,82 %	2,82 %

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtszeitraum aufgelegt.

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Anhang II

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT)

5G Connectivity			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse AUD A	20.05.2020	IE00BMPRXT94	3,58	(45,90)	34,96
Thesaurierende Klasse AUD I2	13.09.2023	IE0002QWGCO8	–	–	13,20
Thesaurierende Klasse CHF A	01.08.2023	IE00BMY47772	–	–	6,20
Thesaurierende Klasse CHF I	01.08.2023	IE00BMY47665	–	–	6,50
Thesaurierende Klasse CHF I2	13.09.2023	IE0003BXK5E5	–	–	13,70
Thesaurierende Klasse CNY A	01.02.2021	IE00BN13NY36	1,38	(43,77)	34,20
Thesaurierende Klasse CNY I2	13.09.2023	IE000VZM9Z74	–	–	13,42
Thesaurierende Klasse EUR A	13.05.2020	IE00BMPRXP56	3,43	(45,94)	34,86
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	22.04.2020	IE00BMD7ZB71	12,60	(39,94)	33,62
Thesaurierende Klasse EUR I	30.06.2020	IE00BMPRXW24	4,27	(45,41)	35,83
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	12.06.2020	IE00BLLXGX96	13,51	(39,41)	34,74
Thesaurierende Klasse EUR I2	13.09.2023	IE00049FOE96	–	–	13,20
Thesaurierende Klasse EUR I5	01.09.2020	IE00BMPRXV17	4,69	(45,20)	36,44
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	22.04.2020	IE00BLLXH031	11,65	(40,38)	32,49
Thesaurierende Klasse GBP A	15.05.2020	IE00BMPRXS87	3,98	(45,24)	36,92
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	02.11.2020	IE00BKS9L945	6,46	(35,98)	31,63
Thesaurierende Klasse GBP I2	13.09.2023	IE000MHA92L4	–	–	13,70
Thesaurierende Klasse HKD A	13.05.2020	IE00BMPRXQ63	4,46	(43,95)	36,82
Thesaurierende Klasse HKD I2	13.09.2023	IE000ZWJU5Z2	–	–	13,90
Thesaurierende Klasse SGD A	14.05.2020	IE00BMPRXR70	4,19	(44,38)	35,90
Thesaurierende Klasse SGD I2	13.09.2023	IE000V6EVRT1	–	–	13,35
Thesaurierende Klasse USD A	04.05.2020	IE00BMPRXN33	4,59	(43,60)	38,16
Thesaurierende Klasse USD E	01.02.2023	IE000ZUB0R86	–	–	19,20
Thesaurierende Klasse USD I	08.04.2020	IE00BLLXGV72	5,51	(43,15)	39,43
Ausschüttende Klasse USD I	08.04.2020	IE00BLLXGW89	5,52	(43,11)	39,43
Thesaurierende Klasse USD I2	10.03.2021	IE00BLR75G15	9,80	(42,99)	39,62
Thesaurierende Klasse USD I3	06.11.2020	IE00BNC26Z17	5,80	(43,02)	39,85
Thesaurierende Klasse USD I5	07.05.2020	IE00BLLXGY04	5,93	(42,92)	40,02
Thesaurierende Klasse USD M	02.06.2020	IE00BMCTKC00	3,68	(44,05)	37,06
Thesaurierende Klasse USD Z	19.03.2021	IE00BMG4Q780	8,80	(42,65)	40,71
Thesaurierende Klasse ZAR A	14.02.2023	IE0009UHWAU4	–	–	25,63
Thesaurierende Klasse ZAR E	10.02.2023	IE000CS9U7B7	–	–	26,25
China A-Share Equity					
Thesaurierende Klasse CNY I	28.07.2020	IE00BLPHVV04	0,20	(22,68)	(12,31)
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	28.07.2020	IE00BMD7Z068	2,35	(28,89)	(14,87)
Ausschüttende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	28.07.2020	IE00BMD7Z175	2,35	(28,97)	(14,81)
China Bond					
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	04.11.2020	IE00BF4ZPF56	(0,72)	(6,70)	2,70
Ausschüttende Klasse CNY I	12.12.2022	IE00BYRGQM22	(0,05)	(6,13)	3,39

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

China Bond (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	**Auflegungsdatum**	**ISIN**	**%**	**%**	**%**
Thesaurierende Klasse CNY Z	08.09.2015	IE00BYRGQQ69	0,60	(5,51)	4,05
Thesaurierende Klasse EUR I	01.12.2020	IE00BN13NX29	(5,48)	–	–
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	20.02.2020	IE00BL1NNM70	9,83	–	–
Thesaurierende Klasse GBP I2	09.02.2021	IE00BNC26Y00	(3,10)	(7,12)	5,67
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich) (nicht währungsgesichert)	12.03.2019	IE00BHXGRN56	3,49	(14,73)	(1,88)
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	08.09.2015	IE00BYQX7S71	2,07	(13,76)	0,49
Thesaurierende Klasse USD Z	29.03.2019	IE00BYRGQJ92	(2,13)	(6,32)	6,85
Thesaurierende Klasse USD Z (nicht währungsgesichert)	10.04.2018	IE00BYRGQN39	2,74	(13,14)	1,02
China Equity					
Thesaurierende Klasse CHF I	31.07.2015	IE00B63FQV68	(7,10)	(24,04)	(25,51)
Thesaurierende Klasse EUR A	14.07.2009	IE00B54BK812	(7,67)	(24,30)	(24,71)
Thesaurierende Klasse EUR I	14.07.2009	IE00B54BLX33	(7,00)	(23,71)	(24,17)
Thesaurierende Klasse EUR Z	03.06.2014	IE00BKJ9MV22	(5,96)	(22,86)	(23,31)
Ausschüttende Klasse GBP A	21.05.2015	IE00BWB9BT54	(7,17)	(23,19)	(23,54)
Ausschüttende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)	23.06.2014	IE00BMN94C76	(4,93)	–	–
Thesaurierende Klasse SGD A	01.12.2014	IE00B5MMRT66	(7,00)	(22,69)	(24,12)
Thesaurierende Klasse USD A	14.07.2009	IE00B543WZ88	(6,70)	(21,93)	(22,83)
Ausschüttende Klasse USD A	27.08.2014	IE00BPRC5H50	(6,67)	(21,94)	(22,81)
Thesaurierende Klasse USD I	14.07.2009	IE00B547N797	(6,01)	(21,33)	(22,22)
Thesaurierende Klasse USD I2	11.08.2014	IE00B8BY0V78	(5,80)	(21,13)	(22,05)
Thesaurierende Klasse USD M	27.05.2016	IE00BYVF7440	(7,63)	(22,70)	(23,52)
Thesaurierende Klasse USD U	27.06.2014	IE00BLSP6051	(6,31)	(21,63)	(22,48)
Thesaurierende Klasse USD Z	01.08.2014	IE00BKJ9MZ69	(4,94)	(20,48)	(21,35)
Climate Innovation[1]					
Thesaurierende Klasse USD A	01.08.2023	IE0006EGSTJ7	–	–	(3,40)
Thesaurierende Klasse USD I	01.08.2023	IE000UGESYW1	–	–	(3,00)
Thesaurierende Klasse USD I5	01.08.2023	IE000YMVHC49	–	–	(2,90)
Thesaurierende Klasse USD Z	01.08.2023	IE0009Q8TA55	–	–	(2,70)
CLO Income					
Thesaurierende Klasse EUR A	09.06.2022	IE000BKR2PI0	–	(3,30)	18,30
Thesaurierende Klasse EUR I	12.07.2018	IE00BG7PQ018	6,56	(8,74)	19,26
Ausschüttende Klasse EUR I2	15.11.2018	IE00BD102V45	6,73	(8,68)	19,33
Ausschüttende Klasse GBP I2	15.11.2018	IE00BD102W51	7,49	(7,13)	–
Ausschüttende Klasse GBP I5	12.07.2018	IE00BD5KHL59	7,72	–	–
Thesaurierende Klasse GBP Z	12.12.2019	IE00BHR46W74	8,11	(6,55)	20,76
Thesaurierende Klasse SEK I	12.07.2018	IE00BG7P3L15	7,04	(8,25)	19,37
Thesaurierende Klasse USD A	09.06.2022	IE000I861U99	–	(1,70)	20,75

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	**Auflegungsdatum**	**ISIN**	**%**	**%**	**%**
Thesaurierende Klasse USD I	12.07.2018	IE00BF4NG566	7,51	(6,91)	21,72
Ausschüttende Klasse USD I	17.08.2023	IE00BF4NG673	–	–	5,97
Ausschüttende Klasse USD I2	21.03.2019	IE00BHXGRM40	7,66	(6,82)	21,73
Ausschüttende Klasse USD I5	12.07.2018	IE00BG7P3H78	7,83	(6,54)	22,04
Thesaurierende Klasse USD Z	18.04.2019	IE00BG7PPZ91	8,37	(6,26)	22,72
Commodities[2]					
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	14.12.2022	IE000GZB3BM6	–	4,30	(11,79)
Thesaurierende Klasse GBP I5	29.03.2022	IE00079M4LO1	–	(5,80)	(7,22)
Thesaurierende Klasse USD A	15.03.2022	IE0004O7KK00	–	(2,90)	(7,31)
Thesaurierende Klasse USD I	09.02.2022	IE000MVZ49F4	–	12,00	(6,52)
Thesaurierende Klasse USD I5	04.03.2022	IE0000TMDNF9	–	(2,20)	(6,24)
Thesaurierende Klasse USD M	14.04.2022	IE000D1UZ4M5	–	(10,90)	(7,86)
Thesaurierende Klasse USD Z	15.02.2022	IE000K7ZYIB8	–	11,64	(5,92)
Corporate Hybrid Bond					
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	23.09.2016	IE00BD5YX427	0,55	(13,56)	8,14
Thesaurierende Klasse CHF P	27.04.2017	IE00BD4H0K73	0,36	(14,46)	6,22
Ausschüttende Klasse CHF P	17.06.2016	IE00BDHBH834	0,37	(14,47)	6,09
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	18.07.2016	IE00BDHBH727	(0,05)	(14,72)	7,57
Thesaurierende Klasse EUR A	03.06.2016	IE00BYV1RN13	(0,08)	(14,66)	7,53
Thesaurierende Klasse EUR I	19.11.2015	IE00BZ090894	0,55	(14,13)	8,14
Ausschüttende Klasse EUR I	19.11.2015	IE00BZ090902	0,55	(14,14)	8,17
Thesaurierende Klasse EUR I2	03.02.2017	IE00BYVF7770	0,59	(14,00)	8,24
Ausschüttende Klasse EUR I2	24.12.2020	IE00BD37NF41	0,59	(14,03)	8,24
Thesaurierende Klasse EUR I3	13.09.2016	IE00BD3H7K78	0,67	(13,95)	8,35
Thesaurierende Klasse EUR I5	19.11.2015	IE00BZ090787	0,85	(13,87)	8,50
Thesaurierende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BD9WHQ23	(0,70)	(15,13)	6,80
Ausschüttende Klasse EUR M	13.02.2017	IE00BZ0BMF67	(0,62)	(15,17)	6,90
Thesaurierende Klasse EUR P	27.04.2017	IE00BYVF7663	0,61	(14,14)	8,23
Ausschüttende Klasse EUR P	24.06.2016	IE00BD37ND27	0,49	(14,05)	8,07
Thesaurierende Klasse GBP I	09.03.2017	IE00BYMJ8V99	1,17	(12,75)	9,87
Thesaurierende Klasse GBP I2	15.05.2017	IE00BDRKGS35	1,28	(12,63)	10,02
Ausschüttende Klasse GBP I2	24.08.2016	IE00BZCPRS46	1,28	(12,63)	9,95
Thesaurierende Klasse GBP P	16.08.2019	IE00BH3W6W54	1,21	(12,71)	9,92
Ausschüttende Klasse GBP P	19.05.2017	IE00BD4H0M97	1,23	(12,77)	9,96
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	02.08.2019	IE00BJR5T361	0,77	(13,05)	8,32
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	18.07.2016	IE00BDHBH610	0,74	(12,77)	9,73
Thesaurierende Klasse USD A	10.08.2016	IE00BD0PCH68	0,79	(12,79)	9,75
Ausschüttende Klasse USD A	23.04.2021	IE00BMT63Q97	0,22	(12,83)	9,67

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Corporate Hybrid Bond (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse USD C1	13.12.2017	IE00BDFBJ677	(0,27)	(13,67)	8,70
Thesaurierende Klasse USD I	14.06.2016	IE00BDHBH503	1,37	(12,29)	10,36
Ausschüttende Klasse USD I	23.04.2021	IE00BMCFKY00	0,58	(12,28)	10,44
Thesaurierende Klasse USD I2	03.02.2017	IE00BDRKGR28	1,47	(12,20)	10,59
Ausschüttende Klasse USD I2	03.02.2017	IE00BD37NK93	1,45	(12,20)	10,45
Thesaurierende Klasse USD M	15.12.2017	IE00BDFBLB65	0,09	(13,36)	9,13
Ausschüttende Klasse USD M	15.12.2017	IE00BDFBJ784	0,15	(13,35)	9,01
Thesaurierende Klasse USD P	05.05.2017	IE00BD4H0L80	1,46	(12,28)	10,36
Thesaurierende Klasse USD Z	20.01.2017	IE00BZ56PT19	1,98	(11,77)	11,06
Developed Market FMP – 2027[1]					
Thesaurierende Klasse EUR A	31.07.2023	IE0006ZF3UO1	–	–	3,10
Ausschüttende Klasse EUR I	15.09.2023	IE000C576DF9	–	–	3,80
Thesaurierende Klasse USD A	31.07.2023	IE000VQRCTO1	–	–	3,80
Ausschüttende Klasse USD A	31.07.2023	IE000OH8VV97	–	–	3,80
Thesaurierende Klasse USD I	31.07.2023	IE000UVYX3U2	–	–	4,00
Ausschüttende Klasse USD I	21.08.2023	IE000ZFOERE3	–	–	4,80
Thesaurierende Klasse USD X	31.07.2023	IE000JGNBMI5	–	–	3,90
Ausschüttende Klasse USD X	31.07.2023	IE000BKPP4O0	–	–	3,90
Emerging Market Debt - Hard Currency					
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	26.02.2019	IE00BF0K7B44	(4,41)	(20,61)	11,27
Ausschüttende Klasse AUD I	26.05.2020	IE00B986FB81	(3,74)	(20,07)	12,11
Thesaurierende Klasse CAD I3 (nicht währungsgesichert)	31.10.2022	IE000ESKKWI7	–	10,40	11,05
Thesaurierende Klasse CHF I2	13.01.2020	IE00BKKL6823	(4,39)	(21,12)	9,31
Thesaurierende Klasse CHF P	24.01.2018	IE00BFNPGF37	(4,44)	(21,23)	9,24
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	16.04.2018	IE00B986FR42	(5,06)	(21,52)	10,37
Thesaurierende Klasse EUR A	31.05.2013	IE00B986FT65	(4,93)	(21,63)	10,49
Thesaurierende Klasse EUR I	31.05.2013	IE00B986G486	(4,25)	(21,06)	11,15
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	17.09.2019	IE00BK5V1269	3,97	(13,70)	9,98
Ausschüttende Klasse EUR I	07.10.2016	IE00B986GB56	(4,36)	(21,04)	11,36
Thesaurierende Klasse EUR I2	18.12.2019	IE00B986GC63	(4,14)	(20,98)	11,44
Ausschüttende Klasse EUR I2	06.11.2019	IE00BK6H5655	(4,16)	(21,02)	11,56
Thesaurierende Klasse EUR I3	29.07.2016	IE00BD0PCJ82	(4,12)	(20,88)	11,44
Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	06.09.2019	IE00BJ7VWB39	4,12	(13,44)	–
Ausschüttende Klasse EUR I3	12.03.2019	IE00BJ2JSZ87	(4,09)	–	–
Thesaurierende Klasse EUR I4	10.12.2015	IE00BXQ9CQ11	(4,04)	(20,87)	11,63
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	05.07.2022	IE000EFKI0A5	–	0,00	10,40
Thesaurierende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BSNLZN33	(5,73)	(22,24)	9,61
Ausschüttende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BSNLZP56	(5,75)	(22,23)	9,68

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Hard Currency (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse EUR P	23.01.2018	IE00BFNPGG44	(4,26)	(21,07)	11,28
Thesaurierende Klasse EUR Z	29.12.2017	IE00BKJB1B19	(3,61)	(20,56)	12,09
Thesaurierende Klasse GBP I	16.12.2016	IE00BDDNB708	(3,72)	(19,88)	12,88
Ausschüttende Klasse GBP I	21.02.2018	IE00BZ1D2402	(3,73)	(19,86)	12,97
Thesaurierende Klasse GBP I2	26.01.2018	IE00B986H344	(3,60)	(19,71)	12,99
Ausschüttende Klasse GBP I2	06.07.2015	IE00B986H450	(3,60)	(19,77)	13,28
Thesaurierende Klasse GBP P	14.03.2018	IE00BF0V1041	(3,70)	(19,85)	12,97
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	09.01.2019	IE00BF0K7C50	(4,16)	(19,74)	11,87
Thesaurierende Klasse JPY I	11.12.2017	IE00BD4H0D07	(3,84)	(21,02)	7,41
Thesaurierende Klasse SEK A	05.11.2015	IE00BYSW3F11	(4,71)	(21,55)	10,56
Thesaurierende Klasse SEK I (nicht währungsgesichert)	14.04.2020	IE00BLDG8V83	6,54	–	–
Thesaurierende Klasse SEK I2	19.05.2021	IE00BN92ZN54	(2,00)	(20,89)	11,51
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	17.02.2015	IE00B99K3R14	(4,10)	(19,90)	11,36
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00B986J720	(4,04)	(19,53)	13,08
Thesaurierende Klasse USD A	31.05.2013	IE00B986J944	(4,05)	(19,51)	13,06
Ausschüttende Klasse USD A	30.10.2020	IE00B986JM76	(4,01)	(19,54)	13,01
Thesaurierende Klasse USD C1	24.08.2017	IE00BDFBJ891	(5,02)	(20,28)	11,95
Thesaurierende Klasse USD I	31.05.2013	IE00B99K4563	(3,32)	(18,98)	13,87
Ausschüttende Klasse USD I	31.05.2013	IE00B99K4670	(3,34)	(18,95)	13,87
Thesaurierende Klasse USD I2	15.11.2016	IE00B99K6R29	(3,23)	(18,80)	13,97
Ausschüttende Klasse USD I2	20.04.2018	IE00B99K6W71	(3,24)	(18,74)	14,00
Ausschüttende Klasse USD I3	20.03.2019	IE00BCFFTG28	(3,14)	(18,77)	14,22
Thesaurierende Klasse USD M	25.08.2017	IE00BDFBJ909	(4,82)	(20,15)	12,21
Ausschüttende Klasse USD M	15.09.2017	IE00BDFBJB28	(4,74)	(20,22)	12,26
Thesaurierende Klasse USD P	11.01.2018	IE00BTKH9G20	(3,33)	(18,86)	13,85
Thesaurierende Klasse USD X	16.12.2021	IE000BX4CH70	0,30	(18,74)	14,11
Thesaurierende Klasse USD Z	26.04.2017	IE00BD4H0C99	(2,70)	(18,34)	14,67
Emerging Market Debt - Local Currency					
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	04.06.2015	IE00BTLWS819	(11,82)	(15,78)	9,48
Thesaurierende Klasse AUD B	04.06.2015	IE00BTLWS702	(11,87)	(15,89)	9,45
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	04.06.2015	IE00BTLWSB42	(12,16)	(15,84)	–
Thesaurierende Klasse AUD C2	04.06.2015	IE00BTLWS926	(11,96)	(15,91)	9,59
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	04.06.2015	IE00BTLWSD65	(11,78)	(15,97)	9,79
Thesaurierende Klasse AUD E	04.06.2015	IE00BTLWSC58	(11,88)	(15,91)	9,46
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	04.06.2015	IE00BTLWSG96	(10,95)	(15,20)	10,70
Thesaurierende Klasse AUD T	04.06.2015	IE00BTLWSF89	(10,97)	(15,01)	10,48
Thesaurierende Klasse EUR A	28.06.2013	IE00B975F382	(11,12)	(15,87)	10,28
Thesaurierende Klasse EUR I	28.06.2013	IE00B975F507	(10,42)	(15,27)	11,02
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	27.06.2017	IE00BD5BKF38	(2,55)	(7,15)	10,09

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt - Local Currency (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	29.12.2015	IE00BZ1J8T56	(2,42)	(7,10)	10,22
Ausschüttende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	12.03.2019	IE00BJ2JSW56	(2,33)	–	–
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	14.03.2017	IE00BYX7M324	(2,29)	(6,87)	10,41
Ausschüttende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	18.02.2016	IE00BD9WJ885	(3,99)	–	–
Thesaurierende Klasse EUR Y (nicht währungsgesichert)	25.01.2021	IE00BMY4BL92	(1,10)	(6,77)	10,41
Thesaurierende Klasse GBP I	22.09.2017	IE00BDZRNT61	(9,84)	(13,95)	12,81
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	02.11.2016	IE00BYX4Q207	(8,30)	(1,63)	7,76
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	02.11.2016	IE00BYSW3D96	(8,32)	(1,63)	7,94
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	25.01.2021	IE00BMY4BM00	(6,40)	(1,50)	7,92
Thesaurierende Klasse SEK A	05.11.2015	IE00BYSW3401	(10,94)	(15,78)	10,22
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	04.03.2015	IE00B99K6K59	(10,26)	(14,02)	11,31
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00B99K7G88	(10,19)	(13,38)	12,99
Thesaurierende Klasse USD A	28.06.2013	IE00B99K7H95	(10,19)	(13,46)	12,98
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	04.06.2015	IE00BTLWSH04	(11,35)	(14,56)	11,71
Thesaurierende Klasse USD B	04.06.2015	IE00B99K7M49	(11,28)	(14,64)	11,51
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	04.06.2015	IE00BTLWSJ28	(11,35)	(14,56)	11,71
Thesaurierende Klasse USD C2	04.06.2015	IE00B99K7Z77	(11,36)	(14,64)	–
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	04.06.2015	IE00BTLWSL40	(11,35)	(14,56)	11,71
Thesaurierende Klasse USD E	04.06.2015	IE00BTLWSK33	(11,28)	(14,64)	11,64
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	02.09.2021	IE00080NF9F1	(6,22)	(12,87)	13,97
Thesaurierende Klasse USD I	28.06.2013	IE00B9Z1CL57	(9,35)	(12,92)	13,88
Ausschüttende Klasse USD I	14.10.2016	IE00BYT43784	(9,46)	(12,85)	13,94
Thesaurierende Klasse USD I2	13.08.2014	IE00B9Z1CN71	(9,27)	(12,69)	14,04
Thesaurierende Klasse USD I5	26.09.2018	IE00BYNVFZ74	(9,97)	(15,46)	12,33
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	31.03.2016	IE00BTLWSM56	(10,34)	(13,76)	12,86
Thesaurierende Klasse USD T	04.06.2015	IE00B9Z1CQ03	(10,40)	(13,81)	12,78
Thesaurierende Klasse USD X	23.10.2013	IE00B9Z1CS27	(9,05)	(12,49)	14,39
Thesaurierende Klasse USD Y	14.01.2021	IE00BMY4BK85	(8,20)	(12,53)	14,32
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	05.06.2015	IE00BTLWSP87	(8,00)	(12,08)	14,22
Thesaurierende Klasse ZAR B	05.06.2015	IE00BTLWSN63	(8,01)	(12,11)	14,18
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	05.06.2015	IE00BTLWSR02	(8,01)	(12,07)	14,29
Thesaurierende Klasse ZAR C2	06.01.2023	IE00BTLWSQ94	(8,01)	(12,10)	12,75
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	05.06.2015	IE00BTLWSS19	(8,02)	(12,07)	14,22
Thesaurierende Klasse ZAR E	05.06.2015	IE00BTLWST26	(8,02)	(12,10)	14,12
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	05.06.2015	IE00BTLWSW54	(7,07)	(11,19)	15,36
Thesaurierende Klasse ZAR T	05.06.2015	IE00BTLWSV48	(7,07)	(11,23)	15,33
Emerging Market Debt Blend					
Ausschüttende Klasse AUD I3	06.11.2019	IE00BKPHTZ39	(2,90)	(11,15)	11,37
Thesaurierende Klasse EUR A	04.12.2015	IE00BK4YZ020	(3,48)	(12,89)	8,28

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Blend (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse EUR I	08.07.2014	IE00BK4YYZ03	(2,75)	(12,29)	8,97
Ausschüttende Klasse EUR I	19.06.2015	IE00BY7S2G49	(2,70)	(12,26)	8,97
Thesaurierende Klasse EUR I2	27.05.2014	IE00BMMV6Y07	(2,60)	(12,16)	9,13
Ausschüttende Klasse EUR I2	24.02.2015	IE00BMMV6Z14	(2,62)	(12,21)	9,24
Ausschüttende Klasse EUR I3	05.11.2019	IE00BLDYHM63	(2,56)	(12,11)	9,37
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	23.03.2017	IE00BD3WDH16	1,71	(8,23)	8,77
Thesaurierende Klasse EUR I5	23.04.2014	IE00BLDYHL56	(2,47)	(11,95)	9,39
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BSNLZD35	(4,26)	(13,62)	7,51
Ausschüttende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BSNLZF58	(4,28)	(13,51)	7,29
Thesaurierende Klasse EUR Z	02.06.2014	IE00BKKN1384	(2,11)	(11,69)	9,86
Thesaurierende Klasse GBP I	31.03.2016	IE00BK4YYR29	(5,56)	(9,05)	8,64
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	12.04.2017	IE00BD3WDG09	(4,91)	(3,22)	6,04
Ausschüttende Klasse GBP I	22.05.2018	IE00BK4YYW71	(5,52)	(9,08)	8,63
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22.05.2018	IE00BF0V1488	(5,00)	(3,16)	5,83
Thesaurierende Klasse GBP P	13.05.2019	IE00BGPZW838	(5,44)	(9,06)	8,68
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	13.05.2019	IE00BGPZW721	(4,95)	(3,24)	5,99
Thesaurierende Klasse GBP Z	17.03.2016	IE00BKKN1509	(4,83)	(8,41)	9,36
Thesaurierende Klasse NOK U	13.03.2017	IE00BZCPRQ22	(5,03)	(9,72)	12,67
Thesaurierende Klasse SEK A	05.11.2015	IE00BMN92P65	(2,08)	(9,24)	8,57
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	15.09.2017	IE00BMN93084	(5,70)	(15,04)	9,75
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	15.09.2017	IE00BRJTF125	(6,53)	(14,64)	11,56
Thesaurierende Klasse USD A	04.02.2016	IE00BK4YYX88	(6,47)	(14,65)	11,44
Thesaurierende Klasse USD C1	24.08.2017	IE00BDFBKG46	(7,41)	(15,50)	10,33
Thesaurierende Klasse USD I	23.04.2014	IE00BK4YYS36	(5,83)	(14,12)	12,28
Ausschüttende Klasse USD I	01.06.2016	IE00BK4YYT43	(5,85)	(13,98)	12,23
Thesaurierende Klasse USD I2	24.09.2014	IE00BMN93423	(5,65)	–	–
Ausschüttende Klasse USD I2	24.02.2015	IE00BMN93530	(5,73)	(13,96)	12,49
Thesaurierende Klasse USD I3	20.12.2017	IE00BD21NN56	(5,61)	(13,90)	–
Thesaurierende Klasse USD I5	24.07.2023	IE00BYSW4H00	–	–	4,00
Thesaurierende Klasse USD M	25.08.2017	IE00BF46ZC54	(7,20)	(15,32)	10,49
Ausschüttende Klasse USD M	26.09.2017	IE00BDFBKH52	(7,18)	(15,37)	10,60
Thesaurierende Klasse USD Z	28.09.2015	IE00BKKN1616	(5,19)	(13,46)	13,08
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend					
Thesaurierende Klasse AUD I2	16.02.2021	IE00BM909D01	(0,70)	(12,69)	7,15
Thesaurierende Klasse NOK I	09.05.2018	IE00BYT26W83	(4,07)	(11,43)	8,34
Thesaurierende Klasse NOK I3	05.09.2023	IE00BYT26Z15	–	–	3,13
Thesaurierende Klasse USD I	10.07.2017	IE00BD3DV032	(4,96)	(14,33)	8,32

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	**Auflegungsdatum**	**ISIN**	**%**	**%**	**%**
Thesaurierende Klasse USD I2	16.03.2021	IE00BMXC7C74	0,40	(14,24)	8,48
Thesaurierende Klasse USD Z	02.11.2017	IE00BD3DV362	(4,39)	(13,84)	9,00
Emerging Markets Equity					
Thesaurierende Klasse AUD B	30.11.2016	IE00BYN4NY18	(7,37)	(27,37)	3,18
Thesaurierende Klasse AUD C2	30.11.2016	IE00BYN4NZ25	(7,44)	(27,37)	3,29
Thesaurierende Klasse AUD E	30.11.2016	IE00BYN4P011	(7,44)	(27,39)	3,18
Thesaurierende Klasse AUD T	30.11.2016	IE00BYN4P128	(6,44)	(26,70)	4,33
Ausschüttende Klasse CAD I (nicht währungsgesichert)	24.01.2018	IE00BF8P8L84	(5,42)	(18,34)	4,89
Ausschüttende Klasse CAD I2	17.12.2021	IE000TTJ7N81	1,60	(24,79)	6,93
Thesaurierende Klasse EUR I	04.10.2010	IE00B3SRML86	(5,58)	(26,37)	5,12
Thesaurierende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BWB99R92	(7,51)	(27,80)	3,04
Thesaurierende Klasse EUR Z	05.02.2018	IE00BKJ9SM50	(4,65)	(25,58)	6,14
Thesaurierende Klasse GBP I	15.01.2014	IE00B3SC5588	(5,09)	(25,19)	6,76
Thesaurierende Klasse GBP Z	17.03.2016	IE00BKJ9SX65	(4,14)	(24,48)	7,94
Thesaurierende Klasse JPY I	04.10.2010	IE00B6780209	6,37	–	–
Thesaurierende Klasse USD A	04.10.2010	IE00B3M56506	(5,58)	(24,66)	6,78
Thesaurierende Klasse USD B	30.11.2016	IE00BYN4P235	(6,52)	(25,34)	5,62
Thesaurierende Klasse USD C2	30.11.2016	IE00BYN4P342	(6,59)	(25,36)	5,53
Thesaurierende Klasse USD E	30.11.2016	IE00BYN4P458	(6,59)	(25,43)	5,63
Thesaurierende Klasse USD I	04.10.2010	IE00B3NBSZ12	(4,63)	(23,86)	7,69
Thesaurierende Klasse USD M	27.05.2016	IE00BYQQ4J61	(6,51)	(25,40)	5,66
Thesaurierende Klasse USD T	30.11.2016	IE00BYN4P565	(5,58)	(24,72)	6,81
Thesaurierende Klasse USD Z	30.06.2014	IE00BKJ9TD35	(3,66)	(23,12)	8,87
Thesaurierende Klasse ZAR B	30.11.2016	IE00BYN4P672	(3,05)	(23,78)	7,83
Thesaurierende Klasse ZAR C2	30.11.2016	IE00BYN4P789	(3,05)	(23,79)	7,82
Thesaurierende Klasse ZAR E	30.11.2016	IE00BYN4P896	(3,05)	(23,78)	7,83
Thesaurierende Klasse ZAR T	30.11.2016	IE00BYN4P904	(2,08)	(23,02)	8,92
Emerging Markets Select Equity*					
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	08.01.2020	IE00BKLC3T45	3,13	(20,04)	–
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	03.12.2018	IE00BG365X48	6,94	(14,04)	–
Thesaurierende Klasse USD I	24.10.2017	IE00BZ3CFW46	(4,07)	(25,02)	–
Ausschüttende Klasse USD I	24.10.2017	IE00BZ3CFV39	(4,13)	–	–
Thesaurierende Klasse USD I5	22.11.2017	IE00BZ3CFZ76	(3,74)	(24,71)	–
Euro Bond					
Thesaurierende Klasse EUR I	13.11.2018	IE00BD9GYJ62	0,94	(15,59)	9,94

* Das Portfolio wurde am 7. September 2023 aufgelöst.

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Euro Bond (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	**Auflegungsdatum**	**ISIN**	**%**	**%**	**%**
Ausschüttende Klasse EUR I	14.11.2018	IE00BFZMGH42	0,94	(15,68)	9,96
Euro Bond Absolute Return					
Thesaurierende Klasse EUR I	29.11.2018	IE00BFZMG962	3,27	(4,71)	8,17
Ausschüttende Klasse EUR I	29.11.2018	IE00BFZMGB89	3,19	(4,58)	8,10
Thesaurierende Klasse EUR I5	28.03.2019	IE00BGL9FP72	3,47	(4,44)	8,34
Thesaurierende Klasse USD Z	22.11.2019	IE00BHXMF734	4,61	(2,25)	10,87
European High Yield Bond					
Thesaurierende Klasse CHF I	14.03.2023	IE00BNH72864	–	–	7,50
Thesaurierende Klasse EUR I	27.06.2014	IE00BNH72V92	3,88	(9,53)	13,53
Thesaurierende Klasse EUR I2	08.11.2023	IE00BNH72Y24	–	–	5,40
Thesaurierende Klasse EUR I5	22.11.2023	IE000U0XGY04	–	–	4,40
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BSNLZ880	2,60	(10,59)	12,11
Thesaurierende Klasse EUR X	20.02.2018	IE00BD2B9W69	4,20	(9,15)	13,96
Thesaurierende Klasse EUR Y	04.01.2023	IE000TAL07E4	–	–	13,00
Ausschüttende Klasse EUR Y	27.06.2023	IE000MDTVTW7	–	–	8,72
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	09.05.2019	IE00BNH73D85	3,98	–	–
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00BNH73J48	4,06	(8,12)	15,17
Thesaurierende Klasse USD I	27.06.2014	IE00BNH73L69	4,69	(7,54)	15,88
Thesaurierende Klasse USD X	12.01.2018	IE00BD2B9Y83	5,06	(7,15)	16,32
Thesaurierende Klasse USD Z	26.04.2019	IE00BPT29L50	5,31	(6,95)	16,53
European Sustainable Equity					
Ausschüttende Klasse EUR A	12.01.2022	IE000YS2J411	–	(20,70)	17,78
Thesaurierende Klasse EUR I	24.02.2021	IE00BMQC7246	21,40	(24,96)	18,99
Ausschüttende Klasse EUR I	24.02.2021	IE00BMQC7B38	21,50	(25,02)	19,00
Ausschüttende Klasse EUR I3	07.10.2021	IE000S1PE6L2	3,70	(24,86)	19,19
Thesaurierende Klasse EUR I5	20.07.2021	IE00BM9TKM36	5,70	(24,69)	19,22
Thesaurierende Klasse EUR M	24.02.2021	IE00BMG4Q673	19,70	(26,23)	16,99
Thesaurierende Klasse EUR Z	29.03.2021	IE00BKP80429	20,90	(24,57)	19,74
Thesaurierende Klasse USD A (nicht währungsgesichert)	15.03.2021	IE00BKPKM643	15,00	(30,17)	22,04
Thesaurierende Klasse USD I (nicht währungsgesichert)	15.03.2021	IE00BNC01617	15,80	(29,62)	23,19
Thesaurierende Klasse USD M (nicht währungsgesichert)	15.03.2021	IE00BKPKM536	14,30	(30,80)	21,11
Event Driven[2]					
Thesaurierende Klasse EUR I	17.01.2023	IE000GM3WKE5	–	–	3,10
Thesaurierende Klasse GBP I5	26.10.2022	IE0004B8PGL9	–	1,10	4,25
Ausschüttende Klasse GBP I5	26.10.2022	IE000TEWJNL5	–	1,10	4,35
Thesaurierende Klasse GBP P	26.10.2022	IE000TQXBRW2	–	1,00	3,96

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Event Driven[2] (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse USD I	26.10.2022	IE000F96D003	–	1,20	4,25
Thesaurierende Klasse USD I5	26.10.2022	IE00033HFZ64	–	1,30	4,74
Global Bond					
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	03.02.2021	IE00BMH55D96	(5,90)	(17,25)	4,22
Thesaurierende Klasse EUR I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	31.08.2023	IE000F6CEDO2	–	–	4,00
Thesaurierende Klasse USD C1	03.01.2018	IE00B8H49690	(6,20)	(16,72)	5,25
Thesaurierende Klasse USD I Benchmark Währungsgesicherte Klasse	26.09.2022	IE000028YR76	–	1,80	7,86
Thesaurierende Klasse USD I	16.07.2012	IE00B8GFHY73	(4,83)	(15,67)	6,54
Thesaurierende Klasse USD M	02.07.2018	IE00BDFBKC08	(5,86)	(16,36)	6,00
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	03.02.2021	IE00BMH55G28	(4,27)	(16,15)	6,03
Thesaurierende Klasse USD Z	20.01.2017	IE00BKJ9T774	(4,48)	(15,41)	6,83
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	03.02.2021	IE00BMH55J58	(1,69)	(13,12)	8,79
Global Diversified Income FMP – 2024					
Thesaurierende Klasse EUR A	07.07.2020	IE00BL1NN727	(1,24)	(6,39)	3,31
Ausschüttende Klasse EUR A	10.07.2020	IE00BL1NN834	(1,25)	(6,28)	3,20
Ausschüttende Klasse EUR I	29.07.2020	IE00BL1NNB65	(0,72)	(6,00)	3,72
Ausschüttende Klasse GBP I	22.06.2020	IE00BK5C7S77	(0,06)	(4,41)	5,42
Ausschüttende Klasse HKD A	28.07.2020	IE00BL1NN271	(0,46)	(4,88)	4,48
Ausschüttende Klasse SGD A	22.06.2020	IE00BL1NNG11	(0,35)	(4,56)	4,11
Thesaurierende Klasse USD A	22.06.2020	IE00BL1NMV96	(0,38)	(4,39)	5,49
Ausschüttende Klasse USD A	22.06.2020	IE00BL1NMW04	(0,41)	(4,28)	5,35
Thesaurierende Klasse USD I	22.06.2020	IE00BL1NMX11	–	(3,99)	5,84
Ausschüttende Klasse USD I	22.06.2020	IE00BL1NMY28	0,01	(3,99)	5,89
Thesaurierende Klasse USD X	22.06.2020	IE00BL1NMZ35	–	(4,08)	5,84
Ausschüttende Klasse USD X	22.06.2020	IE00BL1NN057	(0,06)	(3,94)	5,72
Global Equity Megatrends					
Thesaurierende Klasse EUR I	22.12.2023	IE00BKPHW986	–	–	(0,50)
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	19.10.2018	IE00BFZ89Z14	24,90	(9,70)	16,89
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	05.07.2023	IE000MDM6XI6	–	–	6,30
Thesaurierende Klasse SGD A	08.12.2023	IE000HM1TOC0	–	–	4,25
Thesaurierende Klasse USD A	27.04.2018	IE00BFMHRM44	17,07	(14,51)	21,88
Thesaurierende Klasse USD C1	27.04.2018	IE00BFMHRS06	15,95	(15,40)	20,72
Thesaurierende Klasse USD I	27.04.2018	IE00BFMHRK20	18,26	(13,78)	22,91
Thesaurierende Klasse USD M	27.04.2018	IE00BFMHRT13	16,03	(15,24)	20,92
Thesaurierende Klasse USD Z	25.02.2022	IE00BFMHRN50	–	(12,30)	23,95
Global Flexible Credit Income					
Thesaurierende Klasse CAD I5	18.03.2021	IE00BMDQ4176	3,90	(10,11)	12,10

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse EUR I	29.09.2020	IE00BKPV7063	2,23	(11,99)	10,01
Thesaurierende Klasse EUR M	13.08.2020	IE00BKPV6Z45	0,85	(13,31)	8,65
Thesaurierende Klasse GBP I5	01.06.2020	IE00BMD7Z951	3,27	(10,34)	12,11
Thesaurierende Klasse USD A	16.09.2020	IE00BKPV6V07	2,54	(10,48)	11,81
Thesaurierende Klasse USD I	01.06.2020	IE00BMD7Z621	3,17	(9,91)	12,52
Ausschüttende Klasse USD I	01.06.2020	IE00BMD7Z738	3,10	(9,89)	12,43
Thesaurierende Klasse USD M	16.09.2020	IE00BKPV6Y38	1,61	(11,15)	10,88
Thesaurierende Klasse USD Z	01.06.2020	IE00BMD7Z845	3,78	(9,40)	13,18
Global SDG Engagement					
Ausschüttende Klasse AUD I	03.05.2022	IE00BLRPMZ33	–	(5,65)	8,54
Thesaurierende Klasse CHF I4	03.05.2022	IE000NWK9054	–	(4,70)	6,09
Ausschüttende Klasse CHF I4	03.05.2022	IE000FKA7HA8	–	(4,70)	6,10
Thesaurierende Klasse CHF X	03.05.2022	IE000UJH5394	–	(5,10)	5,37
Thesaurierende Klasse EUR I4	03.05.2022	IE000FQ3GMZ6	–	(4,90)	8,20
Ausschüttende Klasse EUR I4	03.05.2022	IE000R3WKJZ3	–	(4,87)	8,10
Thesaurierende Klasse EUR X	03.05.2022	IE000BDJ74G5	–	(5,40)	7,40
Thesaurierende Klasse EUR Z (PF)	04.08.2016	IE00BD0PCC14	3,38	(12,82)	8,43
Thesaurierende Klasse GBP I4	03.05.2022	IE000HVII8Q5	–	(3,70)	9,97
Thesaurierende Klasse GBP X	03.05.2022	IE000OOR7613	–	(4,10)	9,07
Thesaurierende Klasse USD A	16.08.2016	IE00BZ090126	3,15	(11,66)	9,65
Thesaurierende Klasse USD I	04.08.2016	IE00BYMW5M88	3,73	(11,16)	10,29
Thesaurierende Klasse USD I4	03.05.2022	IE0003AEEC94	–	(3,00)	10,62
Ausschüttende Klasse USD M	29.01.2018	IE00BDFBKM06	2,50	(12,19)	8,93
Thesaurierende Klasse USD X	10.11.2020	IE00BNC27034	4,26	(11,43)	9,76
Thesaurierende Klasse USD Z	04.08.2016	IE00BD0PC768	4,39	(10,66)	11,04
Global High Yield Sustainable Action*					
Thesaurierende Klasse USD I	21.01.2020	IE00BL3NDN61	2,81	(11,49)	–
Ausschüttende Klasse USD I	21.01.2020	IE00BL3NDP85	2,74	(11,52)	–
Thesaurierende Klasse USD X	10.11.2020	IE00BNC27141	3,16	(11,20)	–
Thesaurierende Klasse USD Y	25.02.2021	IE00BMDQ4283	2,80	(11,19)	–

* Das Portfolio wurde am 16. Juni 2023 aufgelöst.

Global Investment Grade Credit					
Thesaurierende Klasse EUR I	27.07.2023	IE000CEVL7G2	–	–	5,10
Thesaurierende Klasse USD I	01.09.2021	IE00BN6JC279	(1,20)	(14,57)	9,60
Thesaurierende Klasse USD X	01.09.2021	IE00BN6JC386	(1,20)	(14,37)	9,81
Thesaurierende Klasse USD Z	01.09.2021	IE00BN6JC493	(1,10)	(14,36)	9,92

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Global Opportunistic Bond			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse EUR I	27.11.2020	IE00BNDQ3Y07	0,10	(13,49)	11,01
Thesaurierende Klasse GBP P	16.01.2020	IE00BJXCZR70	0,76	(12,09)	5,59
Thesaurierende Klasse USD A	22.09.2017	IE00BD3WF316	0,43	(11,82)	5,97
Thesaurierende Klasse USD I	20.12.2016	IE00BD3WD824	0,82	(11,44)	6,23
Ausschüttende Klasse USD I	20.12.2016	IE00BD3WD931	0,81	(11,52)	6,30
Thesaurierende Klasse USD I2	23.04.2018	IE00BF0V1595	0,87	(11,42)	6,30
Thesaurierende Klasse USD M	18.12.2019	IE00BF47NM48	(0,09)	–	–
Thesaurierende Klasse USD Z	16.05.2019	IE00BD3WDB53	1,25	(11,23)	6,57
Global Real Estate Securities					
Ausschüttende Klasse EUR I5	08.07.2021	IE00068K7LS0	9,00	(27,80)	–
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BYNBZJ17	24,20	(29,30)	3,04
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	04.11.2020	IE00BLP47350	38,35	(20,04)	4,80
Thesaurierende Klasse GBP Z	17.03.2016	IE00BSPPW214	27,93	(26,55)	7,39
Thesaurierende Klasse USD A	09.05.2019	IE00BSPPW651	26,67	(26,09)	6,92
Thesaurierende Klasse USD CI	08.01.2020	IE00BF47NP78	25,45	(26,79)	5,82
Thesaurierende Klasse USD I	30.12.2014	IE00BSPPW875	27,63	(25,56)	7,65
Ausschüttende Klasse USD I5	20.12.2019	IE00BL4KJW74	28,03	(25,27)	8,14
Thesaurierende Klasse USD M	02.10.2019	IE00BF47NQ85	25,54	(26,85)	5,78
Thesaurierende Klasse USD Z	13.02.2015	IE00BSPPWG54	28,64	(24,96)	8,43
Global Sustainable Equity					
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	24.02.2021	IE00BL5BFR67	31,80	(23,37)	19,90
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	24.02.2021	IE00BMG4Q566	29,60	(24,92)	17,47
Thesaurierende Klasse EUR Z (nicht währungsgesichert)	31.03.2021	IE00BKP80536	26,80	(23,11)	20,21
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	06.04.2021	IE00BMG4Q459	22,00	(19,26)	16,65
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	06.04.2021	IE00BN6JBK81	22,20	(18,99)	17,07
Thesaurierende Klasse USD A	02.12.2021	IE00BKPKM429	2,40	(28,91)	22,53
Thesaurierende Klasse USD I	24.02.2021	IE00BMQC6Y99	23,30	(28,39)	23,78
Ausschüttende Klasse USD I	24.02.2021	IE00BMQC7139	23,30	(28,30)	23,76
Thesaurierende Klasse USD M	15.03.2021	IE00BKPKM312	21,00	(29,42)	21,55
Thesaurierende Klasse USD Z	25.02.2022	IE000BASSUZ5	–	(16,80)	24,40
Global Sustainable Value					
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BYNBZH92	17,25	(16,84)	12,41
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	27.09.2022	IE0007DELM88	–	0,80	10,32
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	20.10.2023	IE00BDB16154	–	–	7,00
Thesaurierende Klasse USD A	14.08.2017	IE00BSNM7G36	19,42	(13,31)	16,17
Thesaurierende Klasse USD I	18.12.2014	IE00BSNM7J66	20,01	(12,92)	16,70
Thesaurierende Klasse USD I3	31.05.2022	IE0006B0IPZ0	–	(5,30)	16,79

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Global Sustainable Value (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse USD Z	24.05.2016	IE00BSNM7Q34	20,71	(12,53)	17,25
High Yield Bond					
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	05.09.2012	IE00B7VR8263	3,57	(13,52)	8,87
Thesaurierende Klasse AUD A	28.08.2012	IE00B5NTQ667	3,51	(13,50)	8,85
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	22.07.2013	IE00B9276P83	1,72	(14,90)	7,27
Thesaurierende Klasse AUD B	10.12.2020	IE00B8HXFL36	1,79	(14,94)	7,12
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	19.07.2013	IE00B9276Q90	1,73	(14,87)	7,27
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	02.07.2014	IE00BNJZT320	1,92	(14,86)	7,06
Thesaurierende Klasse AUD E	02.07.2014	IE00BNJZT213	1,85	(14,90)	7,13
Ausschüttende Klasse AUD I	29.12.2011	IE00B52MT459	4,11	(13,01)	9,56
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	27.06.2013	IE00B9276R08	2,93	(14,09)	8,27
Ausschüttende Klasse AUD T (Wöchentlich)	11.06.2013	IE00B95QHL52	2,90	(14,08)	8,16
Thesaurierende Klasse AUD T	02.08.2013	IE00B8HXFR97	2,84	(13,96)	8,20
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	23.07.2013	IE00B8HXG658	3,62	(12,76)	9,80
Thesaurierende Klasse CHF A	05.07.2011	IE00B5YDJD53	2,75	(14,78)	6,19
Thesaurierende Klasse CHF I	27.05.2011	IE00B53JGK04	3,41	(14,25)	6,87
Thesaurierende Klasse CHF I2	22.10.2013	IE00BCDYX925	3,48	(14,18)	6,97
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	01.08.2012	IE00B7YPR088	6,52	(11,77)	7,57
Ausschüttende Klasse CNY I (Monatlich)	09.11.2012	IE00B841H259	7,15	(11,23)	8,22
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	19.06.2012	IE00B4024J04	3,04	(14,81)	8,22
Thesaurierende Klasse EUR A	03.05.2006	IE00B12VWB25	2,95	(14,76)	8,25
Ausschüttende Klasse EUR A	24.02.2012	IE00B718SL89	2,95	(14,73)	8,25
Thesaurierende Klasse EUR I	09.11.2009	IE00B12VW904	3,65	(14,30)	8,96
Ausschüttende Klasse EUR I	18.10.2012	IE00B8FFFY43	3,64	(14,32)	9,01
Thesaurierende Klasse EUR I2	05.12.2012	IE00B86LQM64	3,65	(14,18)	9,00
Ausschüttende Klasse EUR I2	05.12.2012	IE00B6TSGL97	3,72	(14,23)	9,00
Thesaurierende Klasse EUR I5	09.01.2020	IE00BKKL6930	3,98	–	–
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BSS7G446	2,43	(15,29)	7,63
Thesaurierende Klasse EUR Z	05.11.2014	IE00BKJ95L31	4,22	(13,73)	9,48
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	07.07.2014	IE00BCDYX818	3,60	(13,21)	10,12
Thesaurierende Klasse GBP A	27.04.2011	IE00B1G9WD45	3,62	(13,18)	9,99
Ausschüttende Klasse GBP A	24.02.2012	IE00B1G9WG75	3,66	(13,27)	9,98
Thesaurierende Klasse GBP I	27.07.2010	IE00B1G9WC38	4,25	(12,69)	10,69
Ausschüttende Klasse GBP I	08.11.2006	IE00B1G9WJ07	4,32	(12,72)	10,56
Thesaurierende Klasse GBP I2	05.12.2012	IE00B76HSR65	4,31	(12,60)	10,81
Ausschüttende Klasse GBP I2	05.12.2012	IE00B8KDTL88	4,24	(12,59)	10,66
Thesaurierende Klasse GBP Z	17.03.2016	IE00BKJ95N54	4,89	(12,10)	11,28
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	14.09.2012	IE00B87ZP976	3,85	(12,84)	9,62
Thesaurierende Klasse SEK A	16.06.2011	IE00B5N0GF80	3,36	(14,24)	8,31

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

High Yield Bond (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	30.03.2012	IE00B513D147	3,82	(12,73)	9,09
Thesaurierende Klasse SGD A	09.03.2012	IE00B3VJ3Q31	3,82	(12,74)	9,14
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	02.05.2012	IE00B4KRFX62	3,84	(12,45)	10,74
Ausschüttende Klasse USD A (Wöchentlich)	22.01.2013	IE00B88XV589	3,85	(12,35)	10,65
Thesaurierende Klasse USD A	11.01.2010	IE00B12VW672	3,85	(12,40)	10,72
Ausschüttende Klasse USD A	24.02.2012	IE00B1G9WM36	3,90	(12,37)	10,72
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	31.10.2012	IE00B9276S15	2,23	(13,86)	9,04
Thesaurierende Klasse USD B	31.10.2012	IE00B9276M52	2,19	(13,72)	8,92
Thesaurierende Klasse USD C	21.11.2012	IE00B8JXNK68	3,20	(12,91)	10,02
Thesaurierende Klasse USD C1	25.10.2017	IE00B8521692	2,90	(13,29)	9,64
Ausschüttende Klasse USD C1	07.09.2017	IE00BF2DC164	2,76	(13,20)	9,55
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	31.10.2012	IE00B9276T22	2,23	(13,86)	8,84
Thesaurierende Klasse USD C2	31.10.2012	IE00B9276N69	2,27	(13,78)	8,91
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	02.07.2014	IE00BLDYHX78	2,15	(13,73)	9,02
Thesaurierende Klasse USD E	02.07.2014	IE00BNJZWJ94	2,25	(13,80)	8,97
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	13.09.2012	IE00B6VF0729	4,39	(11,86)	11,37
Thesaurierende Klasse USD I	03.05.2006	IE00B12VW565	4,51	(11,84)	11,36
Ausschüttende Klasse USD I	16.11.2006	IE00B1G9WK12	4,57	(11,90)	11,36
Ausschüttende Klasse USD I2 (Monatlich)	24.09.2015	IE00BH2RDM00	4,69	(11,82)	11,49
Thesaurierende Klasse USD I2	05.12.2012	IE00B8QBJF01	4,64	(11,74)	11,46
Ausschüttende Klasse USD I2	05.12.2012	IE00B8BBXZ30	4,61	(11,79)	11,55
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	01.06.2016	IE00BYX24752	4,75	(11,71)	11,63
Thesaurierende Klasse USD M	18.02.2016	IE00BD9WHR30	3,26	(12,93)	10,07
Ausschüttende Klasse USD M	01.03.2018	IE00BDFBKN13	3,24	(12,84)	10,05
Thesaurierende Klasse USD P	09.01.2018	IE00BTKH9V70	4,49	(11,82)	11,43
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	31.10.2012	IE00B9276V44	3,31	(12,92)	9,99
Ausschüttende Klasse USD T (Wöchentlich)	11.06.2013	IE00B8B5Y742	3,17	(12,83)	9,91
Thesaurierende Klasse USD T	31.10.2012	IE00B9276L46	3,22	(12,90)	10,07
Ausschüttende Klasse USD U (Monatlich)	02.05.2013	IE00B7Y5Q239	4,28	(12,17)	10,97
Thesaurierende Klasse USD U	09.10.2012	IE00B84LT637	4,22	(12,16)	11,04
Thesaurierende Klasse USD Z	02.05.2014	IE00BKJ9LT35	5,08	(11,29)	12,02
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	11.06.2013	IE00BBGB0S16	6,98	(10,73)	11,90
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	11.06.2013	IE00BBGB0T23	6,98	(10,72)	11,90
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	02.07.2014	IE00BLDYHZ92	6,98	(10,73)	11,90
Thesaurierende Klasse ZAR E	02.07.2014	IE00BNJZT544	6,99	(10,73)	11,90
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	11.06.2013	IE00BBGB0V45	8,05	(9,83)	13,02
Thesaurierende Klasse ZAR T	19.12.2016	IE00BCDYXM56	8,06	(9,83)	13,03
InnovAsia 5G					
Thesaurierende Klasse CHF I4	14.07.2021	IE000R62XXS0	8,60	(41,16)	26,76

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

InnovAsia 5G (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse EUR A	14.07.2021	IE00051SPWY7	8,20	(41,59)	27,69
Thesaurierende Klasse EUR I4	14.07.2021	IE0001S98TH9	8,80	(40,99)	29,28
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	18.10.2021	IE0005LXGGN3	19,40	(36,52)	25,33
Thesaurierende Klasse EUR X	14.07.2021	IE000GVZECQ2	8,30	(41,55)	28,12
Thesaurierende Klasse SGD A	14.07.2021	IE0004VBKI06	8,75	(40,37)	28,60
Thesaurierende Klasse SGD I4	14.07.2021	IE000FO9NFS0	9,40	(39,67)	30,15
Thesaurierende Klasse SGD X	14.07.2021	IE0004JUGJ61	8,90	(40,22)	28,88
Thesaurierende Klasse USD A	14.07.2021	IE00049QBO88	9,00	(39,91)	30,84
Thesaurierende Klasse USD I	14.07.2021	IE000J2D2XC9	9,50	(39,36)	31,93
Thesaurierende Klasse USD I4	14.07.2021	IE0002MSVLE6	9,70	(39,20)	32,38
Thesaurierende Klasse USD M	05.11.2021	IE0005QTSW89	5,10	(40,44)	29,87
Thesaurierende Klasse USD X	14.07.2021	IE0007HVSKH0	9,20	(39,74)	31,16
Japan Equity Engagement					
Ausschüttende Klasse EUR I5	10.02.2022	IE0000I94UW8	–	(5,40)	28,28
Thesaurierende Klasse GBP I5	22.09.2021	IE000OR9P9C5	(6,60)	(12,96)	26,94
Thesaurierende Klasse GBP I5 (nicht währungsgesichert)	06.07.2023	IE000GH63MB3	–	–	7,80
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	11.11.2021	IE0002CL69U2	(6,10)	(15,97)	6,34
Thesaurierende Klasse JPY I	12.05.2020	IE00BLLXGR37	13,83	(14,18)	20,17
Ausschüttende Klasse JPY I	12.05.2020	IE00BLLXGS44	13,83	(14,18)	20,17
Thesaurierende Klasse JPY I5	16.02.2021	IE00BL5B4J15	8,84	(13,81)	20,68
Thesaurierende Klasse JPY Z	28.04.2021	IE00BMD0C484	6,57	(13,44)	21,19
Macro Opportunities FX					
Thesaurierende Klasse EUR I	04.12.2019	IE00BK70Z635	(2,37)	(2,53)	3,25
Thesaurierende Klasse EUR M	04.05.2020	IE00BK527S75	(3,49)	–	–
Thesaurierende Klasse GBP Z	04.12.2019	IE00BG0WMX45	(1,12)	(0,21)	5,56
Thesaurierende Klasse SEK I	11.12.2019	IE00BK70Z742	(1,93)	(1,94)	3,50
Ausschüttende Klasse SEK I	20.10.2021	IE00BL1GVW28	(1,23)	(1,83)	3,49
Thesaurierende Klasse USD I	04.12.2019	IE00BK70Z528	(1,62)	(0,51)	5,69
Thesaurierende Klasse USD X	04.12.2019	IE00BK96H638	(1,11)	–	–
Thesaurierende Klasse USD Z	04.12.2019	IE00BK70Z411	(0,91)	–	6,30
Multi-Asset Income*					
Thesaurierende Klasse EUR I	13.12.2019	IE00BKTC3418	6,41	–	–
Ausschüttende Klasse GBP P	27.02.2020	IE00BKKJBN69	7,13	(12,68)	–
Thesaurierende Klasse USD A	28.02.2018	IE00BYW7V037	6,70	(12,47)	–
Thesaurierende Klasse USD C1	01.03.2018	IE00BF47NK24	5,56	(13,25)	–
Thesaurierende Klasse USD I	28.12.2016	IE00BYX4Q314	7,35	(11,86)	–
Ausschüttende Klasse USD I	28.12.2016	IE00BYX4Q421	7,30	(11,76)	–

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Multi-Asset Income* (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse USD I2	08.09.2021	IE000L8RADS7	0,80	–	–
Thesaurierende Klasse USD M	09.08.2017	IE00BYMJ8K84	5,76	(13,15)	–

* Das Portfolio wurde am 6. Juli 2023 aufgelöst.

Next Generation Mobility					
Thesaurierende Klasse EUR A	07.09.2018	IE00BD6J9V56	21,59	(29,83)	25,13
Thesaurierende Klasse EUR I	13.01.2021	IE00BN6HJT78	16,00	(29,22)	26,19
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	24.06.2020	IE00BKPHW879	33,44	(21,37)	25,09
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	26.10.2018	IE00BD6JB422	31,25	(22,68)	23,03
Thesaurierende Klasse USD A	11.09.2018	IE00BD6J9T35	22,92	(26,86)	28,40
Thesaurierende Klasse USD C1	21.05.2019	IE00BHR06368	21,67	(27,53)	27,05
Thesaurierende Klasse USD I	21.08.2018	IE00BFY81J05	24,03	(26,22)	29,43
Ausschüttende Klasse USD I	21.08.2018	IE00BFLTYG40	23,98	(26,20)	29,46
Thesaurierende Klasse USD M	21.05.2019	IE00BHR06475	21,91	(27,44)	27,44
Thesaurierende Klasse USD X	23.01.2019	IE00BGQVSN72	23,14	(26,74)	28,55
Next Generation Space Economy[2]					
Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	10.05.2022	IE000KBH8HE5	–	(4,90)	23,24
Thesaurierende Klasse EUR M (nicht währungsgesichert)	10.05.2022	IE000RHGM613	–	(6,10)	20,98
Thesaurierende Klasse USD I	10.05.2022	IE000PK18K22	–	(3,90)	27,26
Responsible Asian Debt – Hard Currency					
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	30.06.2015	IE00BYZS6L96	(1,87)	(13,91)	5,82
Thesaurierende Klasse USD A	30.06.2015	IE00BYZS6K89	(1,84)	(13,94)	5,82
Thesaurierende Klasse USD C1	15.10.2019	IE00BJ023P46	(2,86)	(14,82)	4,72
Thesaurierende Klasse USD I	30.06.2015	IE00BYZS6J74	(1,27)	(13,50)	6,45
Ausschüttende Klasse USD I	30.06.2015	IE00BYZS6M04	(1,23)	(13,41)	6,46
Ausschüttende Klasse USD I4 (Monatlich)	23.09.2022	IE000BMKOID8	–	2,30	6,70
Thesaurierende Klasse USD I4	23.09.2022	IE000D2XZZ12	–	2,30	6,74
Thesaurierende Klasse USD M	14.08.2019	IE00BF47N027	(2,45)	(14,48)	5,19
Ausschüttende Klasse USD X (Monatlich)	23.09.2022	IE000Q9JOUE2	–	2,10	5,97
Thesaurierende Klasse USD X	08.06.2021	IE00BN6JC501	(1,30)	(13,48)	5,97
Thesaurierende Klasse USD Z	12.12.2022	IE00BYTHKK92	–	0,10	7,09
Short Duration Emerging Market Debt					
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	31.08.2016	IE00BMN93860	(0,77)	(8,23)	6,06
Ausschüttende Klasse CAD A (Monatlich)	06.11.2015	IE00BMN93G40	(0,61)	(7,71)	6,84
Thesaurierende Klasse CHF A	06.06.2014	IE00BDZRWQ63	(1,54)	(9,78)	3,36
Ausschüttende Klasse CHF A	06.06.2014	IE00BDZRWR70	(1,54)	(9,73)	3,32

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)

			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	**Auflegungsdatum**	**ISIN**	**%**	**%**	**%**
Thesaurierende Klasse CHF I	06.06.2014	IE00BDZRWS87	(1,02)	(9,31)	3,84
Ausschüttende Klasse CHF I	13.06.2014	IE00BDZRWT94	(1,02)	(9,35)	3,84
Thesaurierende Klasse CHF I2	20.02.2015	IE00BDZRWV17	(0,91)	(9,23)	3,96
Ausschüttende Klasse CHF I2	18.04.2017	IE00BNJZW449	(0,96)	(9,17)	3,94
Thesaurierende Klasse CHF I5	31.03.2014	IE00BDZRWX31	(0,81)	(9,16)	4,19
Thesaurierende Klasse CHF P	25.04.2017	IE00BVJF0P79	(1,06)	(9,25)	3,86
Thesaurierende Klasse EUR A	13.06.2014	IE00BDZRWZ54	(1,40)	(9,48)	5,34
Ausschüttende Klasse EUR A	06.06.2014	IE00BDZRX078	(1,30)	(9,51)	5,35
Thesaurierende Klasse EUR I	06.06.2014	IE00BDZRX185	(0,90)	(9,02)	5,81
Ausschüttende Klasse EUR I	06.06.2014	IE00BDZRX292	(0,92)	(8,91)	5,72
Thesaurierende Klasse EUR I2	23.06.2014	IE00BDZRX300	(0,72)	(8,96)	5,86
Ausschüttende Klasse EUR I2	30.03.2017	IE00BDZRX417	(0,80)	(8,89)	5,82
Thesaurierende Klasse EUR I5	14.03.2014	IE00BDZRX524	(0,61)	(8,83)	6,14
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB95M67	(1,99)	(9,94)	4,61
Ausschüttende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB93N35	(1,93)	(9,94)	4,56
Thesaurierende Klasse EUR P	23.02.2017	IE00BYXJQV46	(0,85)	(9,04)	5,86
Thesaurierende Klasse EUR U	06.06.2018	IE00BNJZW555	(1,14)	(9,19)	5,48
Ausschüttende Klasse EUR X	16.03.2020	IE00BL6THB70	(0,77)	(8,92)	5,92
Thesaurierende Klasse GBP A	22.11.2016	IE00BDZRX748	(0,73)	(8,00)	6,90
Thesaurierende Klasse GBP I	16.12.2016	IE00BDZRX961	(0,18)	(7,54)	7,38
Ausschüttende Klasse GBP I	20.02.2018	IE00BDZRXB85	(0,22)	(7,54)	7,43
Thesaurierende Klasse GBP I2	30.09.2016	IE00BDZRXC92	(0,09)	(7,46)	7,48
Ausschüttende Klasse GBP I2	19.10.2017	IE00BDZRXD00	(0,19)	(7,43)	7,47
Ausschüttende Klasse GBP I5	11.04.2014	IE00BDZRXG31	0,05	(7,29)	7,59
Thesaurierende Klasse GBP P	13.08.2019	IE00BGV7J266	(0,29)	(7,46)	7,45
Ausschüttende Klasse GBP P	05.02.2021	IE00BM9TKP66	(0,71)	–	–
Thesaurierende Klasse JPY I	23.02.2015	IE00BDZRXK76	(0,41)	(9,09)	2,10
Ausschüttende Klasse JPY I	22.09.2014	IE00BDZRXL83	(0,41)	(9,09)	2,10
Thesaurierende Klasse SEK A	02.02.2018	IE00BF18PM41	(1,03)	(9,09)	5,45
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00BMN94165	(0,50)	(7,66)	5,98
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00BMN94611	(0,53)	(7,54)	7,45
Thesaurierende Klasse USD A	06.12.2013	IE00BDZRXR46	(0,57)	(7,53)	7,53
Ausschüttende Klasse USD A	06.06.2014	IE00BDZRXS52	(0,52)	(7,55)	7,51
Thesaurierende Klasse USD C1	29.08.2017	IE00BFH58D19	(1,58)	(8,47)	6,48
Ausschüttende Klasse USD C1	29.08.2017	IE00BF2DC271	(1,53)	(8,45)	6,46
Thesaurierende Klasse USD I	31.10.2013	IE00BDZRXT69	–	(7,09)	8,06
Ausschüttende Klasse USD I	02.06.2016	IE00BDZRXW98	(0,01)	(7,07)	8,04
Thesaurierende Klasse USD I2	12.09.2014	IE00BDZRXY13	0,08	(6,99)	8,12
Ausschüttende Klasse USD I2	30.10.2015	IE00BDZRY043	0,09	(6,99)	8,15
Thesaurierende Klasse USD I5	19.03.2014	IE00BDZRY266	0,23	(6,84)	8,35
Ausschüttende Klasse USD I5	09.10.2014	IE00BDZRY597	0,29	(6,87)	8,25

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Short Duration Emerging Market Debt (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	**Auflegungsdatum**	**ISIN**	**%**	**%**	**%**
Thesaurierende Klasse USD M	24.08.2017	IE00BDFBKQ44	(1,10)	(8,13)	6,84
Ausschüttende Klasse USD M	29.08.2017	IE00BDFBKR50	(1,06)	(8,11)	6,84
Thesaurierende Klasse USD P	10.08.2015	IE00BTKH9Z19	–	(7,08)	8,06
Thesaurierende Klasse USD Z	01.04.2014	IE00BKKMWB06	0,46	(6,60)	8,54
Short Duration High Yield SDG Engagement					
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	11.06.2013	IE00B8DK4D30	2,94	(5,86)	7,63
Thesaurierende Klasse CHF A	09.03.2012	IE00B7FN4Q69	2,21	(7,17)	4,84
Thesaurierende Klasse CHF I	20.12.2011	IE00B7FN4P52	2,89	(6,66)	5,50
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	01.08.2012	IE00B8474M21	5,95	(4,07)	6,21
Thesaurierende Klasse EUR A	20.12.2011	IE00B7FN4G61	2,45	(6,92)	6,91
Ausschüttende Klasse EUR A	14.02.2014	IE00B51MHK83	2,54	(7,02)	6,99
Thesaurierende Klasse EUR I	20.12.2011	IE00B7FN4F54	3,05	(6,38)	7,56
Thesaurierende Klasse EUR I2	05.12.2012	IE00B83NML60	3,21	(6,30)	7,71
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB93P58	1,79	(7,49)	6,29
Ausschüttende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB93Q65	1,84	(7,54)	6,39
Thesaurierende Klasse GBP I	17.01.2012	IE00B7FN4H78	3,66	(4,91)	9,26
Ausschüttende Klasse GBP I	20.12.2011	IE00B7FN4M22	3,76	(5,06)	9,38
Thesaurierende Klasse GBP I2	05.12.2012	IE00B87CZ321	3,79	(4,82)	9,31
Ausschüttende Klasse GBP I2	05.12.2012	IE00B7NK7601	3,85	(4,88)	9,44
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	21.09.2022	IE0000C39ZN4	–	0,93	8,25
Thesaurierende Klasse JPY I	28.03.2012	IE00B7FN4K08	3,53	(6,41)	3,75
Ausschüttende Klasse JPY I	19.10.2022	IE00BF0BZ353	–	1,47	3,78
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	17.01.2014	IE00B6RMDS91	3,29	(5,08)	7,74
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	22.01.2014	IE00B7FN5305	3,33	(4,73)	9,25
Thesaurierende Klasse USD A	20.12.2011	IE00B7FN4D31	3,30	(4,79)	9,31
Ausschüttende Klasse USD A	30.11.2012	IE00B7FN5073	3,32	(4,83)	9,25
Thesaurierende Klasse USD C1	02.10.2017	IE00BDFBKS67	2,25	(5,79)	8,19
Thesaurierende Klasse USD I	20.12.2011	IE00B7FN4C24	3,91	(4,18)	9,93
Ausschüttende Klasse USD I	09.01.2012	IE00B7FN4Z50	3,84	(4,15)	9,94
Thesaurierende Klasse USD I2	05.12.2012	IE00B8110967	4,03	(4,17)	10,14
Ausschüttende Klasse USD I2	05.12.2012	IE00B8K3ZX25	4,04	(4,15)	10,02
Thesaurierende Klasse USD I4	10.05.2023	IE00094GH437	–	–	6,60
Thesaurierende Klasse USD I5	08.09.2022	IE000QHA8X05	–	0,40	10,26
Thesaurierende Klasse USD M	25.08.2017	IE00BDFBKT74	2,67	(5,38)	8,63
Ausschüttende Klasse USD M	20.12.2017	IE00BDFBKV96	2,61	(5,37)	8,68
Thesaurierende Klasse USD Z	01.04.2014	IE00BKJ9TG65	4,54	(3,66)	10,60
Strategic Income					
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	15.09.2017	IE00BRJFZ213	1,85	(11,58)	6,42

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Ausschüttende Klasse AUD Z (Monatlich)	01.07.2019	IE00BH3W6Z85	2,88	(10,76)	7,55
Ausschüttende Klasse CNY A (Monatlich)	31.05.2023	IE00BRJFZS74	–	–	4,01
Ausschüttende Klasse EUR A (Monatlich)	07.08.2017	IE00BQR9PJ58	1,18	(12,73)	5,95
Thesaurierende Klasse EUR A	14.11.2022	IE0004VYIY29	–	0,50	5,87
Thesaurierende Klasse EUR I	22.01.2016	IE00B9154717	1,75	(12,32)	6,46
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB97642	0,71	(13,29)	5,28
Ausschüttende Klasse GBP A (Monatlich)	15.09.2017	IE00BRJFZD22	1,91	(11,37)	7,61
Ausschüttende Klasse GBP I (Monatlich)	06.12.2023	IE00BRJFZF46	–	–	2,30
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	15.09.2017	IE00BRJFZH69	2,10	(11,15)	7,28
Thesaurierende Klasse JPY I	26.04.2013	IE00B9F63958	2,27	(12,44)	2,49
Thesaurierende Klasse JPY I (nicht währungsgesichert)	26.04.2013	IE00B9C7XK23	14,52	2,90	16,30
Ausschüttende Klasse JPY I CG	10.08.2015	IE00BYZFYQ11	2,27	(12,44)	2,49
Ausschüttende Klasse JPY I	25.06.2014	IE00BNCBRC28	2,27	(12,44)	2,56
Thesaurierende Klasse JPY Z	01.04.2022	IE000U3RQHX4	–	(8,46)	3,00
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00BRJFZM13	2,17	(10,99)	6,79
Thesaurierende Klasse SGD A	15.09.2017	IE00BQSBQV90	2,10	(10,94)	6,73
Ausschüttende Klasse SGD I (Monatlich)	04.06.2018	IE00BDFDPD26	2,64	(10,48)	7,27
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00B7BTH691	2,14	(10,63)	8,34
Thesaurierende Klasse USD A	11.02.2015	IE00B87L2R26	2,17	(10,61)	8,27
Ausschüttende Klasse USD A	10.08.2016	IE00BD0PCD21	2,14	(10,62)	8,24
Thesaurierende Klasse USD C1	25.08.2017	IE00BDFBLQ19	1,07	(11,51)	7,21
Thesaurierende Klasse USD I	26.04.2013	IE00B8HX1V50	2,70	(10,24)	8,88
Ausschüttende Klasse USD I	10.12.2014	IE00B9DN9Q73	2,65	(10,19)	8,87
Thesaurierende Klasse USD M	18.02.2016	IE00BD9WHS47	1,59	(11,18)	7,66
Ausschüttende Klasse USD M	25.08.2017	IE00BDFBLR26	1,55	(11,16)	7,64
Thesaurierende Klasse USD Z	30.06.2014	IE00BKKMVY67	3,16	(9,69)	9,36
Sustainable Asia High Yield					
Thesaurierende Klasse EUR X	28.01.2022	IE0009LNQCG8	–	(14,90)	0,12
Thesaurierende Klasse GBP X	08.04.2022	IE0002USV3J1	–	(6,90)	1,72
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	13.12.2021	IE0003AW7W04	(1,00)	(16,64)	1,47
Thesaurierende Klasse USD A	13.12.2021	IE000I98A7B6	(1,00)	(16,36)	1,45
Thesaurierende Klasse USD I	13.12.2021	IE000RBQOOF7	(1,00)	(15,76)	2,04
Thesaurierende Klasse USD Z	21.01.2022	IE000I87JBO0	–	(13,43)	2,64
Ausschüttende Klasse USD Z	22.03.2022	IE000HTH7XL4	–	(2,84)	2,56
Sustainable Emerging Market Corporate Debt					
Thesaurierende Klasse CHF I	28.06.2013	IE00B97C6C50	(1,84)	(14,24)	3,74
Thesaurierende Klasse CHF I4	05.11.2019	IE00BK70Z858	(1,53)	(13,94)	–
Thesaurierende Klasse EUR A	17.12.2015	IE00B984JD20	(2,51)	(14,60)	4,73

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Sustainable Emerging Market Corporate Debt (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	**Auflegungsdatum**	**ISIN**	**%**	**%**	**%**
Thesaurierende Klasse EUR I	28.06.2013	IE00B984JG50	(1,63)	(13,94)	5,69
Thesaurierende Klasse EUR I3	29.07.2016	IE00BD3H7L85	(1,40)	(13,64)	5,95
Thesaurierende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BWB97F31	(3,19)	(15,32)	3,89
Ausschüttende Klasse EUR M	18.02.2016	IE00BWB97G48	(3,20)	(15,23)	3,81
Thesaurierende Klasse EUR X	20.07.2015	IE00BXDZNR08	(1,15)	(13,59)	6,08
Thesaurierende Klasse GBP I	28.06.2013	IE00B984KJ54	(0,98)	(12,60)	7,29
Thesaurierende Klasse SEK A	01.02.2018	IE00BYMJ8H55	(2,06)	(14,29)	4,96
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	31.10.2014	IE00B984MC26	(1,57)	(12,64)	6,95
Thesaurierende Klasse USD A	28.06.2013	IE00B984MH70	(1,54)	(12,76)	7,03
Thesaurierende Klasse USD C1	29.08.2017	IE00BDFBJC35	(2,53)	(13,70)	6,01
Thesaurierende Klasse USD I	28.06.2013	IE00B984QG44	(0,73)	(12,06)	7,88
Ausschüttende Klasse USD I	28.06.2013	IE00B984QK89	(0,77)	(12,07)	7,90
Thesaurierende Klasse USD I2	25.03.2015	IE00B984N180	(0,66)	(11,89)	8,05
Thesaurierende Klasse USD I5	11.06.2014	IE00BCFFV006	(0,43)	(11,68)	–
Thesaurierende Klasse USD M	03.10.2017	IE00BDFBJD42	(2,43)	(13,39)	6,08
Ausschüttende Klasse USD M	03.11.2017	IE00BDFBJF65	(2,34)	(13,41)	6,16
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency[2]					
Thesaurierende Klasse EUR I3	26.09.2022	IE000I1CMUN9	–	7,90	10,75
Thesaurierende Klasse EUR I4	13.04.2023	IE000LAZMZO5	–	–	8,30
Thesaurierende Klasse EUR I5	28.12.2022	IE000WNKM6C0	–	0,10	–
Thesaurierende Klasse EUR X	19.01.2022	IE000ROI8ND2	–	(16,40)	10,89
Thesaurierende Klasse USD I	19.01.2022	IE000FZALWJ6	–	(14,60)	13,11
Thesaurierende Klasse USD I5	27.01.2022	IE0007IY0WW3	–	(14,50)	13,57
Tactical Macro[1]					
Thesaurierende Klasse USD I	30.06.2023	IE000PD59QT4	–	–	2,20
Thesaurierende Klasse USD I5	30.06.2023	IE000Y16CQ19	–	–	2,40
Thesaurierende Klasse USD Z	30.06.2023	IE000VOK74I4	–	–	2,60
Ultra Short Term Euro Bond					
Thesaurierende Klasse CHF P	30.05.2022	IE000BN78WH6	–	(2,52)	4,68
Thesaurierende Klasse CHF U	17.12.2019	IE00BL1GVV11	0,66	(5,84)	4,57
Thesaurierende Klasse EUR A	10.06.2021	IE00BNG2T811	(0,17)	(5,75)	6,52
Thesaurierende Klasse EUR I	31.10.2018	IE00BFZMJT78	1,04	(5,59)	6,72
Ausschüttende Klasse EUR I	31.10.2018	IE00BFZMJS61	1,03	(5,58)	6,71
Thesaurierende Klasse EUR I2	27.02.2020	IE00BKLC3S38	1,07	(5,55)	6,76
Thesaurierende Klasse EUR I5	06.02.2019	IE00BHR3GK28	1,12	(5,49)	6,83
Thesaurierende Klasse EUR M	29.07.2021	IE000XRSHD49	(0,50)	(6,31)	6,18
Thesaurierende Klasse EUR U	17.12.2019	IE00BL1GVT98	0,94	(5,68)	6,61

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Ultra Short Term Euro Bond (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse EUR Z	20.12.2018	IE00BH453S87	1,21	(5,38)	6,93
Thesaurierende Klasse USD I	15.09.2021	IE000WMR7CB5	(0,05)	(3,62)	8,93
Thesaurierende Klasse USD Z	24.01.2019	IE00BH453T94	2,01	(3,43)	9,12
Uncorrelated Strategies					
Thesaurierende Klasse CHF I	13.03.2018	IE00BF2F4M73	(1,62)	6,38	(12,28)
Thesaurierende Klasse CHF I5	08.09.2017	IE00BZ3CG211	(1,37)	6,87	–
Thesaurierende Klasse EUR A	20.08.2018	IE00BDC3ND11	(2,16)	5,78	(11,22)
Thesaurierende Klasse EUR I	06.03.2018	IE00BF2F4L66	(1,50)	6,59	(10,56)
Thesaurierende Klasse EUR I2	06.07.2017	IE00BD5BKL97	(1,36)	6,79	(10,41)
Thesaurierende Klasse EUR I5	31.05.2017	IE00BF076079	(1,15)	7,00	–
Thesaurierende Klasse EUR M	15.09.2017	IE00BDC3NF35	(3,00)	4,91	(11,90)
Thesaurierende Klasse EUR P	05.07.2022	IE00093NGSP5	–	(1,50)	(10,36)
Thesaurierende Klasse GBP I	30.06.2017	IE00BF47M490	(0,84)	8,58	(9,11)
Thesaurierende Klasse GBP I2	06.07.2017	IE00BD5BKG45	(0,75)	8,75	(9,00)
Ausschüttende Klasse GBP I2	30.08.2022	IE000R82ESQ2	–	(0,40)	(8,94)
Thesaurierende Klasse GBP I5	31.05.2017	IE00BF076186	(0,55)	9,01	(8,69)
Thesaurierende Klasse GBP P	02.10.2018	IE00BFXBF434	(0,87)	8,67	(9,05)
Thesaurierende Klasse GBP Z	29.06.2017	IE00BYQDD455	(0,18)	9,47	(8,40)
Thesaurierende Klasse JPY I	01.04.2022	IE00BYQDD349	–	2,99	(13,79)
Thesaurierende Klasse SGD A	13.04.2023	IE00BGR6TZ09	–	0,55	(3,25)
Thesaurierende Klasse USD A	26.01.2018	IE00BF076L85	(1,44)	7,50	(9,52)
Thesaurierende Klasse USD C1	06.03.2018	IE00BYW7V144	(2,46)	6,55	(10,50)
Thesaurierende Klasse USD I	31.05.2017	IE00BF075X33	(0,72)	8,33	(8,86)
Thesaurierende Klasse USD I2	06.07.2017	IE00BD5BKM05	(0,63)	8,49	(8,66)
Thesaurierende Klasse USD I5	31.05.2017	IE00BF07FG69	(0,35)	8,72	(8,51)
Thesaurierende Klasse USD M	09.08.2017	IE00BZ3CG328	(2,20)	6,66	(10,28)
Thesaurierende Klasse USD P	12.12.2018	IE00BFZPTC98	(0,65)	8,36	(8,92)
Thesaurierende Klasse USD Z	08.09.2017	IE00BF23SS52	–	9,22	(8,20)
Uncorrelated Trading*					
Thesaurierende Klasse EUR X	14.06.2022	IE000L1JDD81	–	(1,70)	–
Thesaurierende Klasse USD X	6/22/2022	IE0003VEJ4O9	–	0,00	–

* Das Portfolio wurde am 24. Mai 2023 aufgelöst.

US Equity					
Thesaurierende Klasse JPY I3	01.03.2022	IE000XSV3WB9	–	(18,40)	29,66
Thesaurierende Klasse USD A	27.03.2020	IE00BHR06814	20,67	(26,57)	35,83
Thesaurierende Klasse USD I	18.12.2015	IE00BD34ZN73	21,58	(26,01)	36,82

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

US Equity (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	**Auflegungsdatum**	**ISIN**	**%**	**%**	**%**
Ausschüttende Klasse USD I	18.12.2015	IE00BD350682	21,57	(26,03)	36,87
Thesaurierende Klasse USD M	09.02.2022	IE00BHR06B44	–	(22,60)	34,75
US Equity Index PutWrite					
Thesaurierende Klasse EUR I	13.02.2017	IE00BYX7LW42	17,26	(13,09)	12,83
Ausschüttende Klasse EUR I3	03.12.2021	IE000NHZGVS8	3,80	(12,93)	13,03
Thesaurierende Klasse EUR I4	28.04.2017	IE00BD4H0968	17,59	(12,86)	13,13
Ausschüttende Klasse EUR I4	15.12.2023	IE000HG9AHM4	–	–	0,70
Thesaurierende Klasse EUR M	13.02.2017	IE00BYX7LX58	15,76	(14,33)	11,34
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	02.03.2017	IE00BYWPKN37	19,47	0,59	8,91
Thesaurierende Klasse GBP I3	11.05.2021	IE00BMWPYK46	14,90	0,78	9,07
Ausschüttende Klasse GBP I3	03.12.2021	IE00BMD7ZC88	3,71	(11,73)	14,82
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	21.06.2023	IE0007M7EB22	–	–	5,00
Thesaurierende Klasse GBP I4	28.04.2017	IE00BD4H0851	18,06	–	–
Thesaurierende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	25.10.2017	IE00BYXH8345	19,78	0,86	9,11
Ausschüttende Klasse GBP I4	29.11.2023	IE00BD3DV701	18,21	–	2,40
Ausschüttende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	25.08.2021	IE000EORQCL4	5,06	0,64	8,96
Ausschüttende Klasse SGD A (Monatlich)	15.08.2017	IE00BDRKGH20	17,51	(11,67)	13,13
Thesaurierende Klasse USD A	23.01.2017	IE00BDDWGC76	17,51	(11,16)	14,70
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	18.05.2017	IE00BD461232	18,32	(10,66)	15,43
Thesaurierende Klasse USD I	30.12.2016	IE00BDDWG831	18,36	(10,63)	15,39
Thesaurierende Klasse USD I3	24.08.2018	IE00BYXH8121	18,43	–	–
Ausschüttende Klasse USD I3	03.12.2021	IE000VHERIO9	3,90	(10,45)	15,53
Thesaurierende Klasse USD I4	28.04.2017	IE00BD4H0B82	18,63	(10,44)	15,65
Thesaurierende Klasse USD M	13.02.2017	IE00BYX7LY65	16,79	(11,87)	13,80
Thesaurierende Klasse USD Z	10.02.2017	IE00BDDWGF08	19,15	(10,11)	16,08
US Large Cap Value					
Thesaurierende Klasse EUR A	19.10.2022	IE000F8FR4R1	–	8,70	(5,70)
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	21.06.2022	IE000JHJ5WY3	–	6,80	(6,74)
Thesaurierende Klasse EUR I	30.03.2022	IE000NZY26Q1	–	(8,00)	(4,89)
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	19.04.2022	IE000OCOXIH6	–	(5,80)	(5,94)
Ausschüttende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	22.03.2022	IE000ALURE78	–	(0,90)	(5,62)
Thesaurierende Klasse EUR I5 (nicht währungsgesichert)	27.01.2022	IE000SK5XXE9	–	4,20	(5,57)
Thesaurierende Klasse GBP I	22.11.2022	IE000I4SVYD3	–	(2,40)	(3,38)
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22.11.2022	IE000O1H49K2	–	(3,40)	(8,07)
Ausschüttende Klasse GBP I	22.11.2022	IE000YZ914N6	–	(2,40)	(3,39)
Ausschüttende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	22.11.2022	IE000EA4KHA8	–	(3,40)	(8,20)
Ausschüttende Klasse GBP I4 (nicht währungsgesichert)	14.03.2022	IE0005DYIEB4	–	9,20	(7,87)
Thesaurierende Klasse GBP P (nicht währungsgesichert)	08.06.2022	IE0004QFE496	–	2,80	(8,17)

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

US Large Cap Value (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Ausschüttende Klasse GBP P	21.10.2022	IE000VWPWUH3	–	6,30	(3,37)
Thesaurierende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	24.05.2022	IE000YILQ9A8	–	4,80	(8,11)
Ausschüttende Klasse GBP Y (nicht währungsgesichert)	30.08.2022	IE000NVI0WF0	–	2,90	(8,02)
Thesaurierende Klasse USD A	24.03.2022	IE000M9KFDE8	–	(5,00)	(3,37)
Thesaurierende Klasse USD I	20.12.2021	IE0003JM1523	3,90	(1,06)	(2,63)
Ausschüttende Klasse USD I4	21.03.2022	IE000CGMU1E8	–	(3,70)	(2,34)
Thesaurierende Klasse USD I5	11.02.2022	IE000429UFI1	–	(3,50)	(2,28)
Thesaurierende Klasse USD M	25.03.2022	IE000E4YYWX1	–	(6,50)	(4,28)
Thesaurierende Klasse USD Y	08.08.2023	IE000D0QTQS8	–	–	(1,10)
Thesaurierende Klasse USD Z	23.05.2022	IE0008OYN7T5	–	1,00	(1,98)
US Long Short Equity					
Thesaurierende Klasse EUR A	06.07.2015	IE00BPRC5K89	2,73	(10,81)	10,00
Thesaurierende Klasse EUR I	01.12.2014	IE00BJTD3X67	3,74	(10,02)	11,05
Thesaurierende Klasse EUR I3	13.05.2020	IE00BMYMJT70	4,20	(9,68)	11,48
Thesaurierende Klasse EUR I3 (nicht währungsgesichert)	13.05.2020	IE00BMYMJS63	13,11	–	–
Thesaurierende Klasse EUR M	04.12.2015	IE00BWB95R13	1,95	(11,45)	9,11
Thesaurierende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	13.05.2020	IE00BMYMJR56	6,05	–	–
Ausschüttende Klasse GBP I3	08.09.2020	IE00BMXNP376	4,77	(8,20)	13,23
Thesaurierende Klasse SGD A1	31.10.2014	IE00BJTD4N35	3,89	(8,70)	11,31
Thesaurierende Klasse USD A (PF)	10.06.2015	IE00BWB95Q06	3,24	(8,01)	12,29
Thesaurierende Klasse USD A	24.02.2015	IE00BVYJ5W68	3,68	(8,56)	12,39
Thesaurierende Klasse USD A1	03.04.2014	IE00BJTD4V19	3,92	(8,28)	12,75
Ausschüttende Klasse USD I (PF)	13.03.2015	IE00BV9FSD10	4,07	(7,36)	12,83
Thesaurierende Klasse USD I	28.02.2014	IE00BJTCX997	4,66	(7,67)	13,34
Thesaurierende Klasse USD I3	13.05.2020	IE00BMYMKR20	5,05	(7,26)	13,83
Thesaurierende Klasse USD M	09.08.2017	IE00BZ3CG435	2,89	(9,33)	11,48
Thesaurierende Klasse USD U	06.03.2015	IE00BNJZX306	4,17	(8,15)	12,91
Thesaurierende Klasse USD Z	15.05.2014	IE00BKKN1160	6,06	(6,47)	14,97
US Multi Cap Opportunities					
Thesaurierende Klasse AUD E	02.07.2014	IE00BNK02N76	21,75	(20,80)	13,29
Thesaurierende Klasse AUD T	19.12.2016	IE00BCDZ0167	22,99	(20,01)	14,42
Thesaurierende Klasse EUR I3	21.03.2013	IE00B80TLB03	24,38	(19,56)	15,67
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB95S20	21,66	(21,32)	13,14
Thesaurierende Klasse EUR1 A	28.06.2012	IE00B7F25G09	22,90	(20,53)	14,31
Thesaurierende Klasse EUR1 I	28.06.2012	IE00B84HCB79	23,93	(19,84)	15,24
Ausschüttende Klasse GBP I3 (nicht währungsgesichert)	06.11.2017	IE00B7WF5P11	26,72	(6,27)	11,77
Thesaurierende Klasse SGD A	16.07.2013	IE00B3S45H60	23,94	(18,53)	15,26
Thesaurierende Klasse USD B	22.11.2013	IE00BCDZ0381	22,83	(18,72)	15,79

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

US Multi Cap Opportunities (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Thesaurierende Klasse USD C1	13.10.2017	IE00BDFBKF39	22,91	(18,64)	15,93
Thesaurierende Klasse USD C2	22.11.2013	IE00BCDZ0506	22,77	(18,68)	15,84
Thesaurierende Klasse USD E	02.07.2014	IE00BNK02L52	22,77	(18,69)	15,82
Thesaurierende Klasse USD I2	24.05.2023	IE000ZA1BZG7	–	–	12,00
Thesaurierende Klasse USD I3	29.04.2013	IE00B87F0588	25,64	(16,78)	18,48
Ausschüttende Klasse USD I3	30.07.2013	IE00B6W3XJ81	25,64	(16,82)	18,52
Thesaurierende Klasse USD M	18.02.2016	IE00BD9WHM84	22,91	(18,60)	15,94
Thesaurierende Klasse USD T	22.11.2013	IE00BCDZ0720	24,02	(17,85)	16,91
Thesaurierende Klasse USD U	22.01.2013	IE00B819XJ19	24,68	(17,43)	17,60
Thesaurierende Klasse USD Z	02.05.2014	IE00BKJ9MD40	26,28	(16,38)	19,08
Thesaurierende Klasse USD1 A	29.06.2012	IE00B775SV38	24,15	(17,80)	17,07
Thesaurierende Klasse USD1 I	28.06.2012	IE00B7XCGB41	25,19	(17,11)	18,10
Ausschüttende Klasse USD1 I	29.06.2012	IE00B3RSF130	25,22	(17,10)	18,06
Thesaurierende Klasse ZAR B	13.01.2014	IE00BH2RDW08	28,11	(16,64)	18,65
Thesaurierende Klasse ZAR C2	13.01.2014	IE00BH2RDX15	28,11	(16,63)	18,70
Thesaurierende Klasse ZAR E	02.07.2014	IE00BNK02M69	28,11	(16,64)	18,65
Thesaurierende Klasse ZAR T	13.01.2014	IE00BH2RDY22	29,39	(15,80)	19,84
US Real Estate Securities					
Ausschüttende Klasse AUD A (Monatlich)	08.08.2016	IE00BD0PCG51	39,36	(30,39)	7,12
Ausschüttende Klasse AUD B (Monatlich)	16.08.2016	IE00B95Z2Z11	37,59	(31,29)	5,69
Thesaurierende Klasse AUD B	19.08.2015	IE00B8HXG989	37,57	(31,29)	5,70
Ausschüttende Klasse AUD C2 (Monatlich)	16.08.2016	IE00B95S5V74	37,39	(31,26)	–
Thesaurierende Klasse AUD C2	25.09.2015	IE00B8HXGC10	37,51	–	–
Ausschüttende Klasse AUD E (Monatlich)	16.08.2016	IE00BYN4NT64	37,62	(31,32)	5,70
Thesaurierende Klasse AUD E	02.07.2014	IE00BNK02P90	37,51	(31,30)	5,68
Ausschüttende Klasse AUD T (Monatlich)	13.10.2015	IE00B961PR15	38,93	(30,59)	6,79
Thesaurierende Klasse AUD T	16.07.2013	IE00B8HXGG57	38,93	(30,58)	6,68
Thesaurierende Klasse CHF A	11.10.2012	IE00B68CYF25	38,51	(31,16)	5,03
Thesaurierende Klasse EUR A	01.02.2006	IE00B0T0GT17	39,11	(30,97)	7,02
Thesaurierende Klasse EUR I	01.02.2006	IE00B0T0GS00	39,94	(30,40)	7,83
Thesaurierende Klasse EUR M	29.01.2016	IE00BWB97865	37,43	(31,56)	5,94
Ausschüttende Klasse HKD A (Monatlich)	28.07.2016	IE00BD0PCF45	40,05	(28,92)	8,62
Thesaurierende Klasse SGD A	28.05.2013	IE00B45NX917	40,03	(29,19)	7,93
Ausschüttende Klasse USD A (Monatlich)	18.11.2015	IE00B95QR487	40,21	(28,50)	9,67
Thesaurierende Klasse USD A	01.02.2006	IE00B0T0GQ85	40,22	(28,55)	9,72
Ausschüttende Klasse USD A	21.03.2012	IE00B1G9WX41	40,18	(28,53)	9,70
Ausschüttende Klasse USD B (Monatlich)	15.08.2016	IE00B95SNQ81	38,34	(29,45)	8,32
Thesaurierende Klasse USD B	16.07.2013	IE00B8HXHJ53	38,38	(29,46)	8,31
Thesaurierende Klasse USD C1	31.08.2017	IE00BDFBLK56	38,86	(29,25)	8,62

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

US Real Estate Securities (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	Auflegungsdatum	ISIN	%	%	%
Ausschüttende Klasse USD C2 (Monatlich)	16.08.2016	IE00B95TPW15	38,50	(29,43)	–
Thesaurierende Klasse USD C2	16.07.2013	IE00B8HXHK68	38,41	(29,48)	–
Ausschüttende Klasse USD E (Monatlich)	15.08.2016	IE00BYN4NV86	38,34	(29,45)	8,32
Thesaurierende Klasse USD E	02.07.2014	IE00BNK02Q08	38,40	(29,45)	8,29
Ausschüttende Klasse USD I (Monatlich)	19.11.2019	IE00B95SJP96	41,30	(27,96)	10,48
Thesaurierende Klasse USD I	01.02.2006	IE00B0T0GP78	41,31	(28,01)	10,55
Ausschüttende Klasse USD I	14.02.2013	IE00B90CY062	41,27	(28,01)	10,62
Thesaurierende Klasse USD I2	05.12.2012	IE00B8B20D34	41,53	(27,87)	10,78
Thesaurierende Klasse USD M	18.02.2016	IE00BD9WHN91	38,85	(29,27)	8,61
Ausschüttende Klasse USD T (Monatlich)	01.01.2016	IE00BDD1NC38	39,80	(28,73)	9,38
Thesaurierende Klasse USD T	16.07.2013	IE00B8HXHL75	39,80	(28,76)	9,40
Thesaurierende Klasse USD Z	10.02.2015	IE00BKJ9MS92	42,27	(27,44)	11,42
Ausschüttende Klasse ZAR B (Monatlich)	16.08.2016	IE00BD89KB03	44,13	(27,64)	10,53
Thesaurierende Klasse ZAR B	13.03.2015	IE00BCDYZB81	44,17	(27,67)	10,55
Ausschüttende Klasse ZAR C2 (Monatlich)	15.08.2016	IE00BD89K988	44,12	(27,63)	–
Thesaurierende Klasse ZAR C2	11.04.2019	IE00BCDYZD06	44,19	(27,67)	10,56
Ausschüttende Klasse ZAR E (Monatlich)	16.08.2016	IE00BYN4NX01	44,14	(27,63)	10,53
Thesaurierende Klasse ZAR E	02.07.2014	IE00BNK02R15	44,18	(27,67)	10,55
Ausschüttende Klasse ZAR T (Monatlich)	11.06.2013	IE00BBGB0Y75	45,60	(26,91)	11,63
Thesaurierende Klasse ZAR T	26.07.2013	IE00BCDYZG37	45,63	(26,94)	11,67
US Small Cap					
Thesaurierende Klasse AUD B	25.10.2019	IE00B8HXHQ21	14,46	(22,92)	10,41
Thesaurierende Klasse AUD C2	04.09.2018	IE00B8HXHT51	14,40	(22,93)	10,48
Thesaurierende Klasse AUD E	02.07.2014	IE00BNK02S22	14,39	(22,88)	10,39
Thesaurierende Klasse AUD T	19.12.2016	IE00B8HXJ447	15,50	(22,13)	11,54
Thesaurierende Klasse EUR A	28.06.2016	IE00B44F1J46	15,49	(22,62)	11,45
Thesaurierende Klasse EUR A (nicht währungsgesichert)	18.09.2020	IE00B42MJZ94	25,64	(14,66)	10,45
Thesaurierende Klasse EUR I	06.08.2013	IE00B3PY8J28	16,55	(21,97)	12,44
Thesaurierende Klasse EUR I (nicht währungsgesichert)	16.10.2017	IE00B4NQT611	26,73	(13,94)	11,43
Thesaurierende Klasse EUR I2 (nicht währungsgesichert)	24.01.2019	IE00BGSF1T43	26,88	(13,79)	11,53
Thesaurierende Klasse EUR I4 (nicht währungsgesichert)	05.05.2022	IE000NDPFUI3	–	(1,40)	11,76
Thesaurierende Klasse EUR M	04.02.2016	IE00BWB97H54	14,37	(23,39)	10,39
Thesaurierende Klasse EUR Z	31.03.2016	IE00BKJB1D33	17,52	(21,31)	13,39
Ausschüttende Klasse JPY I	29.07.2011	IE00B4TSG157	31,36	(7,47)	23,22
Thesaurierende Klasse USD A	05.07.2011	IE00B64QTZ34	16,74	(19,92)	14,34
Ausschüttende Klasse USD A	28.11.2016	IE00BLDYK493	16,74	(19,93)	14,35
Thesaurierende Klasse USD B	16.07.2013	IE00B8HXJT91	15,51	(20,82)	13,09
Thesaurierende Klasse USD C2	16.07.2013	IE00B8HXK635	15,49	(20,84)	13,13
Thesaurierende Klasse USD E	02.07.2014	IE00BNK02T39	15,47	(20,79)	13,10

Anhang II (Fortsetzung)

PERFORMANCE-DATEN (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

US Small Cap (Fortsetzung)			Geschäftsjahr zum 31. Dezember		
			2021	2022	2023
Anteilklasse	**Auflegungsdatum**	**ISIN**	**%**	**%**	**%**
Thesaurierende Klasse USD I	01.07.2011	IE00B66ZT477	17,78	(19,25)	15,36
Ausschüttende Klasse USD I	10.12.2013	IE00BH2RF025	17,80	(19,26)	15,36
Thesaurierende Klasse USD I3	30.07.2018	IE00B8GCB135	18,06	(19,04)	15,61
Thesaurierende Klasse USD M	18.02.2016	IE00BD9WHP16	15,59	(20,67)	13,17
Thesaurierende Klasse USD T	16.07.2013	IE00B8HXK965	16,65	(20,02)	14,28
Thesaurierende Klasse USD Z	30.08.2016	IE00BKJ9TJ96	18,81	(18,54)	16,27
Thesaurierende Klasse ZAR E	08.08.2017	IE00BNK02V50	20,30	(18,79)	15,46
Thesaurierende Klasse ZAR T	19.12.2016	IE00BH2RF918	21,51	(17,97)	16,62
US Small Cap Intrinsic Value					
Thesaurierende Klasse GBP I (nicht währungsgesichert)	09.03.2021	IE00BLR75F08	12,40	(10,68)	7,77
Thesaurierende Klasse GBP I2 (nicht währungsgesichert)	22.10.2021	IE000HFERTZ5	4,00	(10,48)	7,95
Thesaurierende Klasse JPY I3 (nicht währungsgesichert)	29.08.2023	IE000YD8EH37	–	–	1,25
Thesaurierende Klasse USD A	04.02.2016	IE00BY7S3S36	25,28	(21,29)	13,19
Thesaurierende Klasse USD I	30.04.2015	IE00BX1D4S49	26,31	(20,64)	14,17
Thesaurierende Klasse USD I2	16.03.2022	IE000E90KKM6	–	(15,60)	14,45
Thesaurierende Klasse USD M	27.05.2016	IE00BYQQ4L83	24,04	(22,08)	12,03

[1] Das Portfolio wurde im aktuellen Berichtsjahr aufgelegt, weshalb kein Vergleichszeitraum dargestellt ist.

[2] Das Portfolio wurde im vorangegangenen Berichtsjahr aufgelegt.

Anhang III

INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT)

Messung des Marktrisikos und des Leverage unter Verwendung des Commitment- und VaR-Ansatzes

Die Portfolios streben eine Begrenzung des durch den Einsatz von Derivaten entstehenden Marktrisikos und Leverage (Hebelung) an, indem sie entweder den Commitment-Ansatz oder eine als Value-at-Risk („VaR") bekannte komplexe Methode der Risikomessung anwenden. Der 5G Connectivity, China A-Share Equity, China Equity, Climate Innovation, CLO Income, Corporate Hybrid Bond, Developed Market FMP – 2027, Emerging Markets Equity, European High Yield Bond, European Sustainable Equity, Global Diversified Income FMP – 2024, Global Equity Megatrends, Global SDG Engagement, Global Investment Grade Credit, Global Real Estate Securities, Global Sustainable Equity, Global Sustainable Value, High Yield Bond, InnovAsia 5G, Japan Equity Engagement, Next Generation Mobility, Next Generation Space Economy, Short Duration Emerging Market Debt, Short Duration High Yield SDG Engagement, US Equity, US Large Cap Value, US Multi Cap Opportunities, US Real Estate Securities, US Small Cap und US Small Cap Intrinsic Value enden den Commitment-Ansatz an. Der Commitment-Ansatz berechnet die Hebelung, indem der Marktwert des zugrunde liegenden Derivateengagements im Verhältnis zum NIW des jeweiligen Portfolios gemessen wird. Diese Hebelung wird jedoch zu keinem Zeitpunkt den NIW des Portfolios übersteigen.

Ein Portfolio kann ein „absolutes" VaR-Modell anwenden, bei dem die Messung des VaR relativ zum Nettoinventarwert des Portfolios erfolgt, oder ein relatives VaR-Modell, bei dem die Messung des VaR im Verhältnis zu einer derivatefreien vergleichbaren Benchmark oder einem äquivalenten Portfolio erfolgt. Das von bestimmten Portfolios verwendete Modell ist in der Spalte „Marktrisiko" in nachstehender Tabelle angegeben. Die angewandte VaR-Methode unterliegt mehreren Einschränkungen. Erstens basiert der VaR auf einem Modell für Aktienkursrenditen, das Risikofaktoren verwendet. Insoweit es dabei fehlende Risikofaktoren, fehlspezifizierte Risikofaktoren oder Risikofaktoren gibt, die nicht vorhersehbar sind, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Ferner sind die auf verschiedene Risikofaktoren zurückzuführenden Renditen nicht direkt am Markt beobachtbar und müssen anhand statistischer Techniken geschätzt werden. Insofern diese Schätzungen nicht genau sein können, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Darüber hinaus wird die Kovarianz zwischen den Risikofaktoren über einen bestimmten historischen Zeitraum geschätzt. Insofern sich der künftige Zeitraum vom historischen Zeitraum unterscheidet, ist der VaR möglicherweise kein Indikator für das künftige Risiko. Aus diesen Gründen kann der VaR eher als relativer Risikomaßstab unter Portfolios und nicht als absoluter Risikomaßstab nützlich sein.

Für die Portfolios, die das VaR-Modell anwenden, werden mehrere Berechnungsstandards angewandt. Auf diese Berechnungsstandards wird jedoch im Risikomanagementprozess des Portfolios näher eingegangen, und sie können sich von Zeit zu Zeit im Ermessen des Managers und gemäß den Anforderungen der Zentralbank ändern.

In der nachfolgenden Tabelle ist die maximale, minimale und durchschnittliche Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze für die jeweiligen Portfolios, die den VaR-Ansatz anwenden, für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 aufgeführt:

Portfolio	Marktrisiko	Am 31. Dezember 2023 beobachteter VaR	Maximale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*	Minimale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*	Durchschnittliche Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*
China Bond	Absoluter VaR	1,09 %	9,0 %	5,5 %	7,8 %
Commodities	Relativer VaR	99,3 %	58,5 %	47,8 %	52,8 %
Emerging Market Debt - Hard Currency	Relativer VaR	113,4 %	65,3 %	56,6 %	60,7 %
Emerging Market Debt - Local Currency	Relativer VaR	111,7 %	59,3 %	52,1 %	57,0 %
Emerging Market Debt Blend	Relativer VaR	114,3 %	60,6 %	53,0 %	57,5 %
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	Relativer VaR	100,9 %	78,4 %	47,9 %	51,9 %
Euro Bond	Relativer VaR	89,0 %	57,9 %	44,5 %	52,9 %
Euro Bond Absolute Return	Absoluter VaR	1,77 %	13,2 %	7,9 %	11,7 %
Event Driven	Absoluter VaR	5,00 %	41,9 %	17,4 %	26,1 %
Global Bond	Relativer VaR	102,0 %	56,0 %	49,1 %	51,5 %
Global Flexible Credit Income	Absoluter VaR	3,14 %	27,3 %	14,9 %	19,0 %
Global Opportunistic Bond	Absoluter VaR	4,00 %	24,5 %	18,7 %	21,4 %
Macro Opportunities FX	Absoluter VaR	4,08 %	34,3 %	5,7 %	15,3 %
Responsible Asian Debt - Hard Currency	Relativer VaR	105,4 %	63,4 %	50,0 %	57,4 %
Strategic Income	Absoluter VaR	3,07 %	24,8 %	15,3 %	20,8 %
Sustainable Asia High Yield	Relativer VaR	82,5 %	58,2 %	40,5 %	52,4 %
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	Relativer VaR	106,2 %	58,2 %	53,1 %	56,0 %
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	Relativer VaR	107,6 %	60,1 %	53,1 %	57,0 %

Anhang III (Fortsetzung)

INFORMATIONEN ÜBER DAS GESAMTRISIKO (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Portfolio (Fortsetzung)	Marktrisiko	Am 31. Dezember 2023 beobachteter VaR	Maximale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*	Minimale Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*	Durchschnittliche Ausnutzung der regulatorischen VaR-Grenze*
Tactical Macro	Absoluter VaR	0,64 %	20,6 %	1,7 %	7,6 %
Ultra Short Term Euro Bond	Absoluter VaR	0,81 %	11,0 %	4,1 %	7,7 %
Uncorrelated Strategies	Absoluter VaR	1,04 %	33,2 %	4,7 %	12,9 %
US Equity Index PutWrite	Absoluter VaR	5,75 %	71,5 %	12,8 %	32,7 %
US Long Short Equity	Absoluter VaR	5,28 %	32,1 %	21,3 %	25,6 %

Regulatorische VaR-Grenze für 1M 99% VAR ist 20 %. Für den relativen VaR ist 2* der Benchmark-VaR.

Die Portfolios können in Abhängigkeit von den Marktbedingungen von Zeit zu Zeit Leverage einsetzen. Das „Leverage" wird gemäß den Anforderungen der Zentralbank als Summe der Nennwerte der eingesetzten Derivate berechnet. Das offen gelegte Leverage-Niveau ist nicht als zusätzliches Risiko-Limit für die Portfolios vorgesehen. Auch soll das Leverage-Niveau an sich keinen Hinweis auf das Risikoprofil der Portfolios darstellen. In der nachfolgenden Tabelle ist das während des Geschäftsjahres vorhandene Leverage-Niveau für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 aufgeführt, berechnet als die Summe des absoluten Wertes der Nennwerte der eingesetzten Derivate und angegeben als Prozentsatz vom Nettoinventarwert:

Portfolio	31. Dezember 2023
China Bond	183 %
Commodities	200 %
Emerging Market Debt - Hard Currency	267 %
Emerging Market Debt - Local Currency	296 %
Emerging Market Debt Blend	255 %
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	353 %
Euro Bond	153 %
Euro Bond Absolute Return	205 %
Event Driven	266 %
Global Bond	426 %
Global Flexible Credit Income	230 %
Global Opportunistic Bond	939 %
Macro Opportunities FX	12.164 %
Responsible Asian Debt - Hard Currency	155 %
Strategic Income	193 %
Sustainable Asia High Yield	107 %
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	126 %
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	400 %
Tactical Macro	302 %
Ultra Short Term Euro Bond	137 %
Uncorrelated Strategies	685 %
US Equity Index PutWrite	145 %
US Long Short Equity	164 %

Anhang IV

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (UNGEPRÜFT)

Die Verordnung über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften („SFTR") führt Berichtspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs") und Total Return Swaps ein.

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft (SFT) wird gemäß Artikel 3(11) der SFTR definiert als:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft
- Wertpapier- oder Rohstoffentleih- oder ausleihgeschäfte
- eine Kauf- und Rückkauftransaktion oder Verkaufs- und Rückkauftransaktion oder
- ein Lombardgeschäft

Zum 31. Dezember 2023 hielten die folgenden Portfolios Total Return Swaps als unter den Geltungsbereich der SFTR fallenden Instrumententyp:

CLO Income
Commodities
European High Yield Bond
Event Driven
Global Flexible Credit Income
High Yield Bond
Strategic Income
Uncorrelated Strategies
US Long Short Equity

CLO Income

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	48.732	0,03

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

CLO Income (Fortsetzung)

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US$
Goldman Sachs International	48.732

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 31. Dezember 2023 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Commodities

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	0	0,00
Total Return Swaps – Verbindlichkeiten	0	0,00

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US$
Goldman Sachs International	0

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Commodities (Fortsetzung)

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
Total Return Swaps							
Goldman Sachs International	Barsicherheiten	7.330.000	k.A.	k.A.	USD	Großbritannien	OTC

* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.
** Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.
*** Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.
**** Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2023 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

	%
Getrennte Konten	0 %
Gepoolte Konten	0 %
Sonstiges	100 %
	100 %

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	18.355	0,01

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US$
Goldman Sachs International	18.355

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 31. Dezember 2023 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

European High Yield Bond (Fortsetzung)

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Event Driven

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	959.529	0,76

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US$
Morgan Stanley	959.529

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 31. Dezember 2023 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 3 Monaten und 1 Jahr.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Event Driven (Fortsetzung)

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Global Flexible Credit Income

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	268.263	0,07

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US$
JPMorgan Chase Bank	268.263

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Global Flexible Credit Income (Fortsetzung)

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
Total Return Swaps							
JPMorgan Chase Bank	Barsicherheiten	(200.000)	k.A.	k.A.	USD	USA	OTC

* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.
** Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.
*** Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.
**** Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

High Yield Bond

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Verbindlichkeiten	51.928	0,00

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US$
JPMorgan Chase Bank	51.928

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Zum 31. Dezember 2023 gab es keine Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die in Bezug auf alle Total Return Swaps gestellt oder erhalten wurden.

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	461.585	0,02

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US$
Goldman Sachs International	461.585

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
Total Return Swaps							
Goldman Sachs International	Barsicherheiten	(520.000)	k.A.	k.A.	USD	Großbritannien	OTC

* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.
** Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.
*** Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.
**** Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Strategic Income (Fortsetzung)

Konsolidierte Transaktionsdaten (Fortsetzung):

Die Laufzeiten der Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 lagen zwischen 1 Monat und 3 Monaten.

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten.

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Uncorrelated Strategies

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Vermögenswerte	3.395.463	0,21
Total Return Swaps – Verbindlichkeiten	3.021.166	0,20

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US$
Goldman Sachs International	617.852
JPMorgan Chase Bank	443.988
Morgan Stanley	2.861.379
Société Générale	2.229.122
UBS AG	264.288

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 wurden keine Sicherheiten von der Verwahrstelle entgegengenommen oder gehalten.

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
Total Return Swaps							
Citibank	Barsicherheiten	17.000.000	k.A.	k.A.	USD	Großbritannien	OTC
BNP Paribas	Barsicherheiten	47.910.000	k.A.	k.A.	USD	USA	OTC
Bank of America Merrill Lynch International	Barsicherheiten	7.270.000	k.A.	k.A.	USD	USA	OTC
Morgan Stanley	Barsicherheiten	4.230.000	k.A.	k.A.	USD	USA	OTC
Nomura International PLC	Barsicherheiten	46.360.000	k.A.	k.A.	USD	USA	OTC

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Konsolidierte Transaktionsdaten (Fortsetzung):

	Art der Sicherheit	Betrag US$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
Total Return Swaps (Fortsetzung)							
Société Générale	Barsicherheiten	63.000.000	k.A.	k.A.	USD	Frankreich	OTC
UBS AG London	Barsicherheiten	8.250.000	k.A.	k.A.	USD	Großbritannien	OTC

* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.
** Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.
*** Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.
**** Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten von Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 stellten sich wie folgt dar:

	Betrag US$						
Fälligkeit	**< 1 Tag**	**1 Tag bis zu 1 Woche**	**1 Woche bis zu 1 Monat**	**1 Monat bis zu 3 Monaten**	**3 Monate bis zu 1 Jahr**	**> 1 Jahr**	**offene Laufzeit**
Total Return Swaps - Vermögenswerte	-	-	-	2.549.664	327.396	518.403	-
Total Return Swaps - Verbindlichkeiten	-	-	-	370.564	2.567.730	82.872	-

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2023 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

	%
Getrennte Konten	0 %
Gepoolte Konten	0 %
Sonstiges	100 %
	100 %

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

Uncorrelated Strategies (Fortsetzung)

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

US Long Short Equity

Allgemeine Daten:

Vermögenswerte von Total Return Swaps beliefen sich zum 31. Dezember 2023 auf:

Art von Vermögenswert	Betrag US$	Anteil am NIW (in %)
Total Return Swaps – Verbindlichkeiten	4.635.993	2,36

Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten:

Die Barsicherheiten gehen auf dem Verwahrkonto für das Portfolio ein und werden deshalb nicht speziell nachverfolgt, um eine Wiederverwendung zu ermitteln. Deshalb können wiederverwendete Barsicherheiten nicht angemessen geprüft werden.

Konzentrierte Daten:

Zum 31. Dezember 2023 hat das Portfolio keine Wertpapiere als Sicherheiten für die Total Return Swaps erhalten.

Die Gegenparteien von allen Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 waren wie folgt:

Gegenpartei	Betrag US$
Goldman Sachs International	2.434.032
JPMorgan Chase Bank	2.201.961

Verwahrung erhaltener Sicherheiten:

Zum 31. Dezember 2023 werden alle erhaltenen Sicherheiten bei der Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited, verwahrt.

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Konsolidierte Transaktionsdaten:

Die konsolidierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (Barmittel inbegriffen), die für alle Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 gestellt oder erhalten wurden, stellten sich wie folgt dar:

	Art der Sicherheit	Betrag US$*	Qualität**	Laufzeit (Sicherheiten)***	Währung von Sicherheiten	Gründungsland der Gegenpartei****	Abwicklung und Clearing
Total Return Swaps							
Goldman Sachs International	Barsicherheiten	7.530.000	k.A.	k.A.	USD	Großbritannien	OTC
JP Morgan Chase Bank	Barsicherheiten	7.620.000	k.A.	k.A.	USD	USA	OTC

* Barsicherheiten können eine Kombination aus Swap-Instrumenten umfassen, da ein Teil der Sicherheiten sich auf nicht unter den Geltungsbereich der SFTR fallende Swap-Vereinbarungen bezieht.
** Für Baranlagen oder Verbindlichkeiten gibt es kein Kreditrating. Aufgrund ihrer höchst liquiden Natur gelten auf US-Dollar lautende Barmittel als von höchster Qualität.
*** Aufgeteilt in 7 Fälligkeitssegmente (< 1 Tag, 1 Tag bis zu 1 Woche, 1 Woche bis zu 1 Monat, 1 Monat bis zu 3 Monaten, 3 Monate bis zu 1 Jahr, > 1 Jahr, offene Laufzeit). Barsicherheiten haben keine Laufzeit.
**** Das Land entspricht der Adresse der aktuellen Gegenpartei.

Die Laufzeiten von Positionen in Total Return Swaps zum 31. Dezember 2023 stellten sich wie folgt dar:

	Betrag US$						
Fälligkeit	**< 1 Tag**	**1 Tag bis zu 1 Woche**	**1 Woche bis zu 1 Monat**	**1 Monat bis zu 3 Monaten**	**3 Monate bis zu 1 Jahr**	**> 1 Jahr**	**offene Laufzeit**
Total Return Swaps - Verbindlichkeiten	-	-	-	2.348.409	2.102.134	185.450	-

Verwahrung gestellter Sicherheiten:

Der Anteil der Sicherheiten, die zum 31. Dezember 2023 auf getrennten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wurden, war wie folgt:

	%
Getrennte Konten	0 %
Gepoolte Konten	0 %
Sonstiges	100 %
	100 %

Anhang IV (Fortsetzung)

VERORDNUNG ZU WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN (FORTSETZUNG)

US Long Short Equity (Fortsetzung)

Ertrag/Kosten:

Bei Total Return Swaps sind Transaktionskosten, falls zutreffend, nicht separat identifizierbar. Bei diesen Anlagen sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis enthalten und sind Teil der Bruttoanlageperformance der einzelnen Portfolios. Renditen werden als realisierte Gewinne/Verluste und die Veränderung der nicht realisierten Gewinne/Verluste aus den Swap-Kontrakten während der Berichtsperiode identifiziert.

Zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 war keines der Portfolios an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.

Anhang V

ANGABEN ZUR VERGÜTUNG (UNGEPRÜFT)

Die Richtlinie der Europäischen Union 2014/91/EU (die „OGAW-V Richtlinie") trat am 18. März 2016 in Kraft. Der Fonds hat eine Vergütungspolitik eingeführt, um den Anforderungen der OGAW-V-Richtlinie und der ESMA-Leitlinien für solide Vergütungspolitiken gemäß der OGAW-V-Richtlinie in einer Form und in dem Umfang zu entsprechen, wie es der Größe des Fonds, seiner internen Organisation und der Art, dem Gegenstand und der Komplexität seiner Aktivitäten angemessen ist.

Die Vergütungspolitik des Fonds gilt für identifizierte Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds haben.

Zum 31. Dezember 2023 hatte der Fonds keine Mitarbeiter, und die Vergütungspolitik des Fonds gilt nur für Mitglieder des Direktoriums des Fonds, die den Fonds verwalten und kontrollieren. Nähere Angaben zu den Honoraren der Direktoren finden sich in Anmerkung 7.

Die Direktoren ernannten NBAMIL zum Manager, um die laufenden Geschäfte des Fonds zu führen. NBAMIL hat eine Vergütungspolitik im Einklang mti der OGAW-V-Richtlinie angenommen. Nähere Angaben zu den in den zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 von NBAMIL vereinnahmten Gebühren finden sich in Anmerkung 10.

Anhang VI

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT)

Bloomberg Commodity Index	Der Index ist ein rollierender Index, der sich aus börsengehandelten Futures-Kontrakten auf physische Rohstoffe zusammensetzt. Der Index verlässt sich bei der Bestimmung der relativen Mengen der aufgenommenen Rohstoffe vor allem auf Liquiditätsdaten von Futureskontrakten sowie auf USD-bereinigte Produktionsdaten. Der Index soll eine hoch liquide und diversifizierte Benchmark für Rohstoffanlagen sein. Die Indexversion, die auf Basis der Gesamtrendite berechnet wird, spiegelt die Renditen auf eine voll besicherte Anlage in den zugrunde liegenden Rohstoff-Futureskontrakten wider, kombiniert mit den Renditen auf in US Treasury Bills investierten Barsicherheiten.
Bloomberg Euro Aggregate Bond Index (Total Return, abgesichert, EUR)	Der Index umfasst festverzinsliche, in Euro denominierte Anleihen mit Investment-Grade-Rating. Die Aufnahme basiert auf der Währung der Emission und nicht auf dem Domizilland des Emittenten. Die wichtigsten Sektoren des Index sind Staatsanleihen, Unternehmensanleihen, regierungsnahe Anleihen und verbriefte Emissionen.
Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Total Return, Hedged, USD)	Bei dem Index handelt es sich um ein führendes Maß für globale festverzinsliche Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating. Diese mehrere Währungen enthaltende Benchmark umfasst Anleihen von Emittenten der Sektoren Industrie, Versorgung und Finanzwesen aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index ist Bestandteil der Global Aggregate and Multiverse Indizes.
Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, abgesichert, USD)	Der Index misst globale Schuldtitel mit Investment Grade von vierundzwanzig verschiedenen lokalen Währungsmärkten und umfasst festverzinsliche Treasuries, regierungsnahe Titel sowie Unternehmens- und verbriefte Anleihen von Emittenten aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index besteht im Wesentlichen aus drei wichtigen regionalen Aggregatkomponenten: dem Bloomberg US Aggregate Bond Index, dem Bloomberg Pan-European Aggregate Bond Index und dem Bloomberg Asian-Pacific Aggregate Index. Neben Wertpapieren aus diesen drei Indizes enthält der Index zudem Papiere mit Investment Grade (Eurodollar, Euro-Yen, kanadische) und für den Index geeignete 144A Wertpapiere, die nicht bereits in diesen drei Indizes enthalten sind. Der Index ist voll in USD abgesichert.
Bloomberg Global Aggregate Index (Total Return, nicht abgesichert, USD)	Der Index misst globale Schuldtitel mit Investment Grade von vierundzwanzig verschiedenen lokalen Währungsmärkten und umfasst festverzinsliche Treasuries, regierungsnahe Titel sowie Unternehmens- und verbriefte Anleihen von Emittenten aus Industrie- und Schwellenländern. Der Index besteht im Wesentlichen aus drei wichtigen regionalen Aggregatkomponenten: dem Bloomberg US Aggregate Bond Index, dem Bloomberg Pan-European Aggregate Bond Index und dem Bloomberg Asian-Pacific Aggregate Index. Neben Wertpapieren aus diesen drei Indizes enthält der Index zudem Papiere mit Investment Grade (Eurodollar, Euro-Yen, kanadische) und für den Index geeignete 144A Wertpapiere, die nicht bereits in diesen drei Indizes enthalten sind.
Bloomberg US Aggregate Bond Index (Total Return, USD)	Der Index misst den in US-Dollar denominierten, festverzinslichen, steuerpflichtigen Markt für Anleihen mit Investment Grade und umfasst Treasuries, regierungsnahe Titel und Unternehmensanleihen, Mortgage Backed Securities (Agency Fixed Rate und Hybrid Variable Rate Mortgage Pass-Throughs), forderungsbesicherte Anleihen (Asset-Backed Securities sowie Commercial Mortgage-Backed Securities (Agency und Non-Agency). Der Index ist eine breit angelegte Benchmark, die den in US-Dollar denominierten, festverzinslichen, steuerpflichtigen Markt für Anleihen mit Investment Grade misst. Dazu gehören Treasuries, regierungsnahe Titel und Unternehmensanleihen, hypothekarisch besicherte Anleihen (MBS), forderungsbesicherte Anleihen (ABS) sowie besicherte MBS.

Anhang VI (Fortsetzung)

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Cboe S&P 500 PutWrite Index	Der Index bildet den Wert einer passiven Anlagestrategie ab, die aus einem Overlay von S&P 500 (SPX) Short-Verkaufsoptionen über ein in ein- und dreimonatige Schatzwechsel investiertes Geldmarktkonto besteht. Die SPX-Verkaufsoptionen werden At-The-Money ausgeführt und monatlich verkauft.
Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index	Der Index bildet die Wertentwicklung einer hypothetischen Strategie ab, die wöchentlich eine At-the-Money (ATM) S&P 500 Index (SPX)-Verkaufsoption verkauft. Die Fälligkeit der geschriebenen SPX-Verkaufsoption ist eine Woche vor Verfall. Die geschriebene SPX-Verkaufsoption wird über ein in einmonatige Schatzwechsel investiertes Geldmarktkonto besichert. Der Index wird wöchentlich aktualisiert, üblicherweise jeden Freitag.
FTSE Chinese Government and Policy Bank Bond 0-1 Year Select Index (Total Return, CNY)	Der Index misst die Wertentwicklung von auf CNY lautenden, festverzinslichen Staatsanleihen in stückloser Form sowie von Policy Bank Bonds, die auf dem chinesischen Festland ausgegeben wurden. Die folgenden Instrumente sind ausgeschlossen: Sparbriefe, spezielle Staatsanleihen, Zentralbankwechsel, Privatplatzierungen und abrufbare und kündbare Anleihen.
FTSE EPRA Nareit Developed Real Estate Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von börsennotierten Immobiliengesellschaften und Real Estate Investment Trusts (REITs) in Industrieländern messen soll. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren.
FTSE Nareit All Equity REITs Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)	Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von an der New York Stock Exchange oder der NASDAQ notierten steuerbegünstigten Immobiliengesellschaften (REITs) abbildet. Eigenkapital-REITs umfassen alle steuerbegünstigten REITs mit mehr als 50 Prozent des Gesamtvermögens an qualifizierten Immobilienanlagen mit Ausnahme von grundpfandrechtlich gesicherten Hypotheken.
HFRX Equity Hedge Index (Total Return, USD)	Der Index soll Aktien-Hedgefondsstrategien repräsentieren, die überwiegend Long- und Short-Positionen in Aktien und Aktien-Derivaten halten. Aktien-Hedge-Manager würden in der Regel mindestens 50 % und können in manchen Fällen im Wesentlichen vollständig in Long- als auch Short-Aktienpositionen investiert sein.
ICE BofA European Currency Non-Financial High Yield 3% Constrained Index (Total Return, EUR)	Der Index misst die Wertentwicklung von in Euro und GBP denominierten Unternehmensanleihen unterhalb von Investment Grade von Nichtfinanzunternehmen, die am Eurobondmarkt und Sterling- oder Euro-Inlandsmärkten öffentlich begeben werden. Das Engagement in einem Emittenten ist auf 3 % begrenzt. Der Index enthält alle nicht finanziellen Wertpapiere des ICE BofA European Currency High Yield Index, begrenzt aber das Engagement bei individuellen Emittenten auf 3 %.
ICE BofA Global High Yield Constrained Index (Total Return, Hedged, USD)	Der Index bildet die Wertentwicklung von in USD, CAD, GBP und EUR denominierten Unternehmensanleihen unterhalb Investment Grade ab, die an den wichtigsten Inlands- oder Eurobondmärkten öffentlich begeben werden. Das Engagement in jedem der im Index enthaltenen Emittenten ist auf maximal 2 % des Index begrenzt. Der Index enthält alle Wertpapiere des ICE BofA Global High Yield Index, begrenzt aber das Emittentenrisiko auf 2 %.
ICE BofA Global Hybrid Non-Financial 5% Constrained Custom Index (Total Return, Hedged, Euro)	Der Index bildet die Wertentwicklung von nicht finanziellen hybriden Unternehmensanleihen mit Investment Grade ab, die öffentlich an wichtigen Inlands- und Eurobond-Märkten begeben werden, wobei die Gewichtung jedes Emittenten auf maximal 5 % begrenzt ist.
ICE BofA US Dollar 1-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)	Der Index ist eine weit verbreitete Benchmark für kurzfristige Zinssätze. Er gibt einen Hinweis auf die Durchschnittskurse, zu denen Banken für bestimmte Zeiträume in bestimmten Währungen ungesicherte Interbankkredite aufnehmen können.

Anhang VI (Fortsetzung)

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index (Total Return, USD)	Der Index bildet die Wertentwicklung eines synthetischen Vermögenswerts ab, der bis zu einer angegebenen Fälligkeit den SOFR-Satz zahlt. Der Index basiert auf dem angenommenen Kauf eines synthetischen Instruments mit genau derselben angegebenen Fälligkeit und einem Kupon in Höhe des an diesem Tag geltenden Fixingkurses. Es wird davon ausgegangen, dass diese Emission am folgenden Werktag verkauft (mit einer Rendite in Höhe des an diesem Tag geltenden Fixingkurses) und in ein neues Instrument umgewandelt wird.
ICE BofA US High Yield Constrained Index (Total Return, USD)	Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Unternehmensanleihen ohne Investment Grade ab, die öffentlich auf dem US-Inlandsmarkt begeben werden. Neben der Erfüllung anderer Kriterien müssen zulässige Wertpapiere ein Rating unterhalb von Investment Grade aufweisen (basierend auf dem Durchschnitt der Ratings von Moody's, S&P und Fitch) und Risiken gegenüber G10 FX-Ländern, Westeuropa oder Gebieten der USA und Westeuropas ausgesetzt sein. Wertpapiere, die rechtlich in Verzug sind, werden vom Index ausgeschlossen. Indexkomponenten sind kapitalisierungsgewichtet, sofern die Gesamtallokation bei einem einzelnen Emittenten 2 % nicht überschreitet.
ICE BofA 0-1 Year AAA Euro Government Index (Total Return, EUR)	Der Index ist eine Teilmenge des ICE BofA All Maturity Euro Government Index einschließlich aller Wertpapiere mit einer Fälligkeit von weniger als 1 Jahr und einem Rating von AAA. Der Index bildet die Wertentwicklung von in EUR denominierten Staatsanleihen ab, die von den Euro-Mitgliedsländern öffentlich entweder auf dem Eurobondmarkt oder dem Heimatmarkt des Emittenten begeben werden. Die zulässigen Länder müssen Euro-Mitglieder sein, über ein Investment Grade Rating für langfristige Staatsschulden in Fremdwährung verfügen (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P und Fitch) und über mindestens eine leicht zugängliche, transparente Preisquelle für ihre Wertpapiere verfügen. Um für die Aufnahme in Betracht gezogen zu werden, muss ein Land zum ersten eines Monats Euro-Mitglied sein.
ICE BofA 3-Month US Treasury Bill Index (Total Return, USD)	Der Index besteht aus einer einzelnen US Treasury Bill-Emission, die zu Beginn eines jeden Monats gekauft und einen ganzen Monat lang gehalten wird. Zum Monatsende wird diese Emission verkauft und durch eine neu ausgewählte Emisison ersetzt, die am nächsten zu drei Monaten ab dem Datum des Neuausrichtung, aber nicht darüber hinaus, fällig wird.
JP Morgan Asia Credit Index (JACI) (Total Return, USD)	Der Index bildet die Gesamtertragsperformance für aktiv gehandelte, in US-Dollar denominierte Schuldtitel in der Region Asien (ohne Japan) ab. JACI ist ein marktkapitalgewichteter Index, der Staatsanleihen, quasistaatliche und Unternehmensanleihen umfasst und nach Ländern, Sektoren und Kreditrating unterteilt ist.
JP Morgan ESG Asia Credit High Yield Index (Total Return, USD) (JESG JACI)	Der Index bildet die Gesamtertragsperformance für aktiv gehandelte, in US-Dollar denominierte Schuldtitel in der Region Asien (ohne Japan) ohne Investment Grade ab, die bestimmte ESG-Kritierien erfüllen.
JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index (CEMBI)-Diversified Index (Total Return, USD)	Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Unternehmensanleihen aus Schwellenländern ab, darunter Schwellenländer aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die diversifizierte Version des Index ist marktkapitalisierungsgewichtet und begrenzt die Gewichtungen der Indexländer mit größeren Unternehmensschuldtiteln, indem sie nur bestimmte Teile der zulässigen aktuellen Beträge der ausstehenden Schuldtitel dieser Länder berücksichtigt. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JP Morgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.

Anhang VI (Fortsetzung)

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

JP Morgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (Total Return, USD)	Der Index bildet die Wertentwicklung von in US-Dollar denominierten Schuldtiteln staatlicher und quasistaatlicher Emittenten aus Schwellenländern (Brady-Anleihen, Kredite und Euroanleihen) ab, darunter Schwellenländer aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die globale Version des Index erfasst ein breites, umfassendes Universum von Emissionen aus Schwellenländern. Die diversifizierte Version des Index ist marktkapitalisierungsgewichtet und begrenzt die Gewichtungen der Indexländer mit größeren Schuldtiteln, indem sie nur bestimmte Teile der zulässigen aktuellen Beträge der ausstehenden Schuldtitel dieser Länder berücksichtigt. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JP Morgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.
JP Morgan ESG CEMBI Broad Diversified (Total Return, USD)	Der Index bildet in US-Dollar denominierte fest - und variabel verzinsliche Schuldtitel aus Schwellenländern ab, die von Unternehmen emittiert werden. Der Index wendet eine ESG-Scoring- und Screening-Methode an, um einerseits Emittenten, die laut ESG-Kriterien höher eingestuft sind, sowie grünen Anleihen den Vorzug zu geben und andererseits Emittenten, die niedriger eingestuft sind, unterzugewichten und zu entfernen.
JP Morgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified Index (Total Return, USD)	Der Index bildet die Wertentwicklung von liquiden, in US-Dollar denominierten fest- und variabel verzinslichen Schuldtiteln staatlicher und quasistaatlicher Emittenten aus Schwellenländern (Brady-Anleihen, Darlehen und Eurobonds) ab, die eine Restlaufzeit von mindestens 2,5 Jahren haben. Der Index wendet eine ESG-Scoring- und Screening-Methode an, um einerseits Emittenten, die laut ESG-Kriterien höher eingestuft sind, sowie grünen Anleihen den Vorzug zu geben und andererseits Emittenten, die niedriger eingestuft sind, unterzugewichten und zu entfernen.
JP Morgan Government Bond Index (GBI)-Emerging Markets Global Diversified (Total Return, nicht währungsgesichert, USD)	Der Index bildet die Wertentwicklung von Anleihen in lokaler Währung ab, die von Regierungen der Schwellenländer ausgegeben wurden, einschließlich Schwellenländern aus Asien, Europa, Lateinamerika und dem Nahen Osten/Afrika. Die globale Version des Index enthält nur Länder, die für den Großteil der internationalen Anleger zugänglich sind. Länder mit expliziten Kapitalkontrollen sind ausgeschlossen. Die diversifizierte Version des Index ist nach Marktkapitalisierung gewichtet. Die Höchstgewichtung pro Land beträgt 10 %. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JP Morgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.
MSCI All Country World Index (ACWI) (Total Return, abzüglich Steuern, USD)	Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, kapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von Industrie- und Schwellenländern messen soll. Der Index besteht aus 47 Länderindizes, die 23 Industrie- und 24 Schwellenländerindizes umfassen. Die enthaltenen Indizes aus Industrieländern sind: Australien, Österreich, Belgien, Kanada, Dänemark, Finnland, Frankreich, Deutschland, Hongkong, Irland, Israel, Italien, Japan, die Niederlande, Neuseeland, Norwegen, Portugal, Singapur, Spanien, Schweden, die Schweiz, das Vereinigte Königreich und die USA. Die enthaltenen Schwellenländerindizes sind: Brasilien, Chile, China, Kolumbien, Tschechien, Ägypten, Griechenland, Ungarn, Indien, Indonesien, Korea, Kuwait, Malaysia, Mexiko, Peru, die Philippinen, Polen, Katar, Saudi-Arabien, Südafrika, Taiwan, Thailand, die Türkei und die VAE. Chinesische A-Aktien werden seit dem 1. Juni 2018 aufgenommen und sind seit November 2019 teilweise mit 20 % ihrer um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung vertreten. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren. Mit Wirkung nach Börsenschluss am 9. März 2022 stufte MSCI den Status des MSCI Russia Index um, und zwar von Emerging Markets auf den Status eines eigenständigen Marktes. Zu diesem Zeitpunkt wurden alle russischen Wertpapiere zu einem Endpreis von 0,00001 aus diesem Index entfernt, einschließlich lokal gehandelter russischer Aktien und der russischen ADRs/GDRs.

Anhang VI (Fortsetzung)

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

MSCI All Country World (ACWI) Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, kapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung von Large- und Mid-Cap-Aktien mit, im Großen und Ganzen, Value-Merkmalen aus 23 entwickelten Märkten und 24 Schwellenmärkten repräsentiert. Die Merkmale des Value-Anlagestils für diesen Index werden anhand von drei Variablen definiert: Verhältnis zwischen Kurs und Buchwert (KBV), Verhältnis zwischen Kurs und Gewinn (KGV) basierend auf Prognosen für die nächsten zwölf Monate und Dividendenrendite.
MSCI China A Onshore Index (Total Return, CNY)	Bei dem Index handelt es sich um einen kapitalisierungsgewichteten Index, dessen Komponentenzahl variieren kann und der so konzipiert ist, dass er die Wertentwicklung der breiten Volkswirtschaft der VRC anhand von Veränderungen des Gesamtmarktwerts der größten Aktien misst, die alle maßgeblichen Branchen repräsentieren.
MSCI China All Shares Index (Total Return, USD)	Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, nach Marktkapitalisierung gewichteter Index, der die Aktienmarktperformance chinesischer Anteilklassen messen soll, die in Hongkong, Shanghai, Shenzhen und außerhalb Chinas notiert sind. Er deckt das integrierte Aktienuniversum des MSCI China ab, das A-Aktien, B-Aktien, H-Aktien, Red Chips, P-Chips und ausländische Notierungen außerhalb Chinas oder Hongkongs (z. B. ADRs) umfasst. A-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an den Börsen von Shanghai und Shenzhen gehandelt. Sie notieren in Renminbi und unterliegen den Vorschriften für ausländische Investitionen (QFII). B-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an den Börsen von Shanghai und Shenzhen gehandelt. Sie notieren Fremdwährungen (Shanghai USD, Shenzhen HKD) und sind für ausländische Anleger zugänglich. H-Aktien sind Aktien von in China gegründeten Unternehmen und werden an der Börse in Hongkong und anderen ausländischen Börsen gehandelt. Red Chips und P-Chips sind Papiere von Unternehmen , die außerhalb Chinas gegründet werden und an der Börse in Hongkong handeln. Red Chips werden in der Regel vom Staat oder einer Provinz oder Gemeinde kontrolliert. P-Chips sind nicht staatliche chinesische Unternehmen, die außerhalb des Festlandes gegründet wurden und in Hongkong gehandelt werden. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren.
MSCI Emerging Markets Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)	Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von Schwellenländern messen soll. Der Index besteht aus den folgenden 24 Schwellenländerindizes: Brasilien, Chile, China, Kolumbien, Tschechien, Ägypten, Griechenland, Ungarn, Indien, Indonesien, Korea, Kuwait, Malaysia, Mexiko, Peru, die Philippinen, Polen, Katar, Saudi-Arabien, Südafrika, Taiwan, Thailand, die Türkei und die VAE. Chinesische A-Aktien werden seit dem 1. Juni 2018 aufgenommen und sind seit November 2019 teilweise mit 20 % ihrer um den Streubesitz bereinigten Marktkapitalisierung vertreten. Mit Wirkung nach Börsenschluss am 9. März 2022 stufte MSCI den Status des MSCI Russia Index um, und zwar von Emerging Markets auf den Status eines eigenständigen Marktes. Zu diesem Zeitpunkt wurden alle russischen Wertpapiere zu einem Endpreis von 0,00001 aus diesem Index entfernt, einschließlich lokal gehandelter russischer Aktien und der russischen ADRs/GDRs. Netto-Gesamtertragsindizes reinvestieren Dividenden nach Abzug der Quellensteuern unter Verwendung eines Steuersatzes (für internationale Indizes), der für gebietsfremde institutionelle Anleger gilt, die nicht von Doppelbesteuerungsabkommen profitieren.
MSCI Europe Index (Total Return, abzüglich Steuern, EUR)	Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von entwickelten Märkten in Europa messen soll.

Anhang VI (Fortsetzung)

GLOSSAR DER INDIZES (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

MSCI Japan Small Cap Net Index (Total Return, JPY)	Der Index soll die Wertentwicklung des Small-Cap-Segments des japanischen Marktes messen.
MSCI World Index (Total Return, abzüglich Steuern, USD)	Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Aktienmarktperformance von entwickelten Märkten messen soll.
Russell 1000 Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Large-Cap-Value-Segments des US-Aktienmarktes misst. Dazu gehören die Unternehmen im Russell 1000 Index, die ein niedrigeres KBV und niedrigere prognostizierte Wachstumsraten aufweisen. Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet.
Russell 2000 Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Small-Cap-Segments des US-Aktienmarktes misst. Er enthält etwa 2.000 der kleinsten Wertpapiere im Russell 3000 Index (der die Performance der 3.000 größten US-amerikanischen Aktiengesellschaften anhand der gesamten Marktkapitalisierung misst). Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet.
Russell 2000 Value Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Der Index ist ein um den Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der die Wertentwicklung des Small-Cap-Value-Segments des US-Aktienmarktes misst. Dazu gehören die Unternehmen im Russell 2000 Index, die ein niedrigeres KBV und niedrigere prognostizierte Wachstumsraten aufweisen. Der Index wird jedes Jahr im Juni neu ausgerichtet.
S&P 500 Index (Total Return, Net of Tax, USD)	Der Index ist um den Streubesitz bereinigt und marktkapitalisierungsgewichtet, mit Schwerpunkt auf dem Large-Cap-Segment des US-Aktienmarktes. Er umfasst einen wesentlichen Anteil des Gesamtwerts des Marktes.
Gewichteter Durchschnitt aus 2/3 JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total Return, USD) und 1/3 JP Morgan GBI EM Global Diversified Index Investment Grade 15% Cap Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD)	Der kombinierte Index setzt sich zu 2/3 aus dem JP Morgan EMBI Global Diversified Investment Grade Index (Total return, USD) (wie zuvor beschrieben) und zu 1/3 aus dem JP Morgan GBI-EM Global Diversified Index Investment Grade 15% Cap Index (Total return, USD, nicht währungsgesichert) (wie zuvor beschrieben) zusammen und wird monatlich neu ausgerichtet.
50% JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified Index (Total Return, nicht währungsgesichert, USD), 25% JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) und 25% JP Morgan CEMBI Diversified Index (Total Return, USD)	Der kombinierte Index setzt sich zu 50% aus dem JP Morgan GBI Emerging Markets Global Diversified, zu 25% aus dem JP Morgan EMBI Global Diversified und zu 25% aus dem JP Morgan CEMBI Diversified (alle zuvor beschrieben) zusammen und wird monatlich neu ausgerichtet. Mit Wirkung vom 31. März 2022 wurden Russland und Weißrussland aus den JP Morgan Fixed Income Indizes ausgeschlossen. Der Marktwert des Index für alle russischen und weißrussischen Schuldtitel wurde auf null festgesetzt, was einen Verlust der gesamten Rendite aufgrund der Marktstörung reflektiert.
50% Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index / 50% Cboe S&P 500 PutWrite Index	Der kombinierte Index setzt sich zu 50 % aus dem Cboe S&P 500 One-Week PutWrite Index (wie zuvor beschrieben) und zu 50 % aus dem Cboe S&P 500 PutWrite Index (wie zuvor beschrieben) zusammen.

Anhang VII

MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT)

Nähere Angaben zu den Managern, Sub-Investment-Managern und Unterberatern sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt.

Fondsname	Manager	Sub-Investment-Manager	Unterberater (verbunden)	Unterberater (nicht verbunden)
5G Connectivity	Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL")	Neuberger Berman Investment Advisers LLC („NBIA") Neuberger Berman Asia Limited („NBAL")		
China A-Share Equity	NBAMIL	NBIA NBAL		
China Bond	NBAMIL	NBIA Neuberger Berman Singapore Pte. Limited („NBS") NBAL	Neuberger Berman Fund Management (China) Limited („NB China")	
China Equity	NBAMIL			Green Court Capital Management Limited („Green Court")
Klimainnovation	NBAMIL	NBIA NBEL		
CLO Income	NBAMIL	NBIA		
Commodities	NBAMIL	NBIA NBEL		
Corporate Hybrid Bond	NBAMIL	NBIA NBS		
Developed Market FMP – 2027	NBAMIL	NBIA NBEL		
Emerging Market Debt – Hard Currency	NBAMIL	NBIA NBS		
Emerging Market Debt – Local Currency	NBAMIL	NBIA NBS	NB China	
Emerging Market Debt Blend	NBAMIL	NBIA NBS	NB China	
Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend	NBAMIL	NBIA NBS		
Emerging Markets Equity	NBAMIL	NBIA NBAL		
Euro Bond	NBAMIL			
Euro Bond Absolute Return	NBAMIL			

Anhang VII (Fortsetzung)

MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Fondsname	Manager	Sub-Investment-Manager	Unterberater (verbunden)	Unterberater (nicht verbunden)
European High Yield Bond	NBAMIL	NBIA		
European Sustainable Equity	NBAMIL	NBIA		
Event Driven	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
Global Bond	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global Diversified Income FMP – 2024	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global Equity Megatrends	NBAMIL	NBIA		
Global Flexible Credit Income	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global SDG Engagement	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global Investment Grade Credit	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
Global Opportunistic Bond	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Global Real Estate Securities	NBAMIL	NBIA		
		NBAL		
Global Sustainable Equity	NBAMIL	NBIA		
Global Sustainable Value	NBAMIL	NBIA		
		Neuberger Berman Canada ULC („NB Canada")		
High Yield Bond	NBAMIL	NBIA		
InnovAsia 5G	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
		NBAL		
Japan Equity Engagement	NBAMIL	Neuberger Berman East Asia Limited („NBEAL")		
Macro Opportunities FX	NBAMIL	NBIA		
Next Generation Mobility	NBAMIL	NBIA		
		NBAL		

Anhang VII (Fortsetzung)

MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Fondsname	Manager	Sub-Investment-Manager	Unterberater (verbunden)	Unterberater (nicht verbunden)
Next Generation Space Economy	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
Responsible Asian Debt – Hard Currency	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Short Duration Emerging Market Debt	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Short Duration High Yield SDG Engagement	NBAMIL	NBIA		
Strategic Income	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Sustainable Asia High Yield	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
		NBS		
Sustainable Emerging Market Corporate Debt	NBAMIL	NBIA		
		NBS		
Sustainable Emerging Market Debt - Hard Currency	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
		NBS		
Tactical Macro	NBAMIL	NBIA		
		NBEL		
Ultra Short Term Euro Bond	NBAMIL	NBEL		
Uncorrelated Strategies	NBAMIL	NBIA	NB Alternatives Advisers LLC („NBAA")	Altiq LLP
				BH-DG Systematic Trading LLP
				P/E Global LLC
				True Partner Capital USA Holding Inc
				Cipher Capital LP
				G10 Capital Limited
				Crabel Capital Management, LLC
				AllianceBernstein L.P.
				Portman Square Capital LLP
				Soloda Investment Advisors LLP

Anhang VII (Fortsetzung)

MANAGER, SUB-INVESTMENT-MANAGER UND UNTERBERATER (UNGEPRÜFT) (FORTSETZUNG)

Fondsname	Manager	Sub-Investment-Manager	Unterberater (verbunden)	Unterberater (nicht verbunden)
US Equity	NBAMIL	NBIA		
US Equity Index PutWrite	NBAMIL	NBIA		
US Large Cap Value	NBAMIL	NBEL		
		NBIA		
US Long Short Equity	NBAMIL	NBIA		
US Multi Cap Opportunities	NBAMIL	NBIA		
US Real Estate Securities	NBAMIL	NBIA		
US Small Cap	NBAMIL	NBIA		
US Small Cap Intrinsic Value	NBAMIL	NBIA		

Anhang VIII

OFFENLEGUNGSVERORDNUNG (UNGEPRÜFT)

Die folgenden Portfolios wurden als Artikel-6-Portfolio für die Zwecke der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rats vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR") kategorisiert: Neuberger Berman CLO Income Fund (CLO Bond Portfolio), Neuberger Berman US Equity Index Putwrite Fund, Neuberger Berman Macro Opportunities FX Fund, Neuberger Berman Tactical Macro Fund (Liquid Alternatives Portfolios), Neuberger Berman US Small Cap Intrinsic Value Fund (US Equity Portfolios), Neuberger Berman China Equity Fund (China Portfolios), Neuberger Berman Uncorrelated Strategies Fund, Neuberger Berman Uncorrelated Trading Fund (Multi Strategy Portfolios), Neuberger Berman Commodities Fund (Quantitative and Multi Asset Portfolios) und Neuberger Berman Event Driven Fund (Global Equity Portfolios).

Für die Zwecke der Taxonomie-Verordnung wird darauf hingewiesen, dass die Anlagen in zugrunde liegenden Artikel-6-Portfolios den EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht Rechnung tragen.

Die folgenden Portfolios wurden als Artikel-8-Portfolios für die Zwecke der SFDR klassifiziert: Neuberger Berman High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund, Neuberger Berman European High Yield Bond Fund, Neuberger Berman Global SDG Engagement Fund, Neuberger Berman Global High Yield Sustainable Action Fund (High Yield Bond Portfolios), Neuberger Berman Emerging Market Debt – Local Currency Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund, Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund, Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund, Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend Fund, Neuberger Berman Responsible Asian Debt – Hard Currency Fund, Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (Emerging Market Debt Portfolios), Neuberger Berman China Bond Fund (China Bond Portfolios), Neuberger Berman Global Bond Fund, Neuberger Berman Strategic Income Fund, Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund, Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund, Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund, Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (Fixed Income Portfolios), Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024, Neuberger Berman Developed Market FMP - 2027 (Fixed Maturity Portfolios), Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund, Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund, Neuberger Berman Euro Bond Fund (Euro Fixed Income Portfolios), Neuberger Berman Multi-Asset Income Fund, Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund (Quantitative and Multi Asset Portfolios), Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (Liquid Alternatives Portfolios), Neuberger Berman US Equity Fund, Neuberger Berman US Small Cap Fund, Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund, Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (US Equity Portfolios), Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund, Neuberger Berman Emerging Markets Select Equity Fund, Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (Global Equity Portfolios), Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund, Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (Real Estate Portfolios), Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (China Portfolios), Neuberger Berman 5G Connectivity Fund, Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund, Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund, Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund, Neuberger Berman Metaverse Fund, Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund, Neuberger Berman Climate Innovation Fund (Thematic Equity Portfolios), Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund und Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (Sustainable Equity Portfolios) (die „Artikel-8-Portfolios"). Informationen zu den ökologischen und sozialen Merkmalen der Artikel-8-Fonds, mit Ausnahme der nicht aufgelegten Fonds, sind im Anhang unten verfügbar. Wir machen keine weiteren Angaben zum Neuberger Berman Metaverse Fund, da er nicht aufgelegt wurde.

Der Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (Emerging Market Debt Portfolios) wurde zum Zwecke der SFDR als Artikel-9-Portfolio (das „Artikel-9-Portfolio") kategorisiert.

Im Einklang mit den Anforderungen von Artikel 11 der SFDR wurden keine Informationen in Bezug auf jedes Artikel-8-Portfolio und das Artikel-9-Portfolio in diesen Anhang aufgenommen. Sofern nicht anderweitig in diesem Anhang definiert, haben Begriffe in Großbuchstaben die ihnen in diesem Prospekt verliehene Bedeutung.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman 5G Connectivity Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300H0HOXG52ES7840

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 56,8 %* an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

- ***Soziale Merkmale:*** Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanz-produkt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,5	ES: A-D G: 1-4	96 %
Daten von Dritten	6,8	0-10	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 6,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 96 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D	0-10	0-100%

	G: 1-4		
Bezugszeitraum 2022	ES: B G: 2,7	6,5	100 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B G: 2,5	6,8	96 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

Die Bewertung G-Ratings des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Rating des Unternehmens.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-2,6 %	97 %
Bezugszeitraum 2023	-6,1 %	96 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

  Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

  Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**").

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**"):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1- THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle

Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

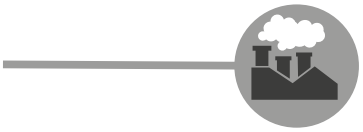
Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

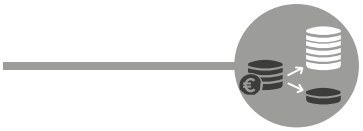
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ADVANCED MICRO DEVICES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4 %	USA
NVIDIA CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4 %	USA
SERVICENOW INC	J - Information and Communication	4 %	USA
T MOBILE US INC	J – Information und Kommunikation	3 %	USA
MICROSOFT CORP	J – Information und Kommunikation	3 %	USA
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3 %	Taiwan (Republik China)
PALO ALTO NETWORKS INC	J – Information und Kommunikation	3 %	USA
HUBSPOT INC	J – Information und Kommunikation	3 %	USA
ARISTA NETWORKS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3 %	USA
ORACLE CORP	J – Information und Kommunikation	3 %	USA
AMAZON COM INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3 %	USA
ASM INTERNATIONAL NV	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3 %	Niederlande
DEXCOM INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2 %	USA
META PLATFORMS INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	2 %	USA
BROADCOM INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

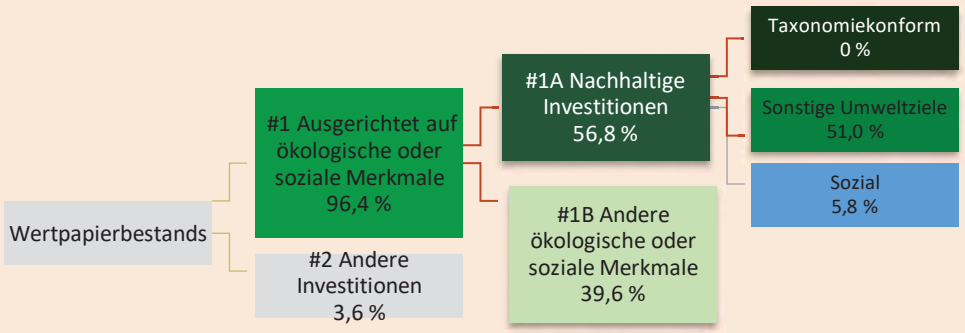
- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,4 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 10 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 56,8 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,6 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	61,1 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,7 %
J – Information und Kommunikation	33,2 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,0 %

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

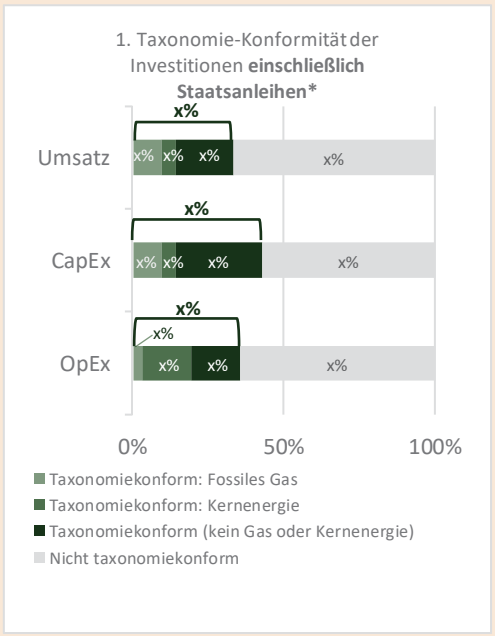
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

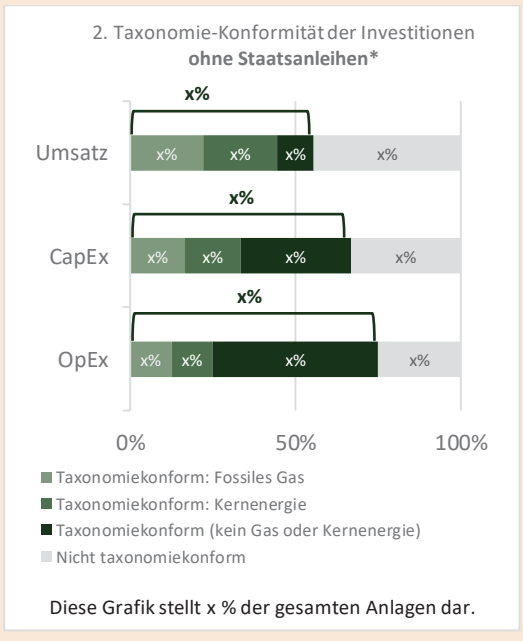
☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 51,0 % an nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 5,8 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe Rating oder das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen lag, die sich an der Entwicklung und Verbesserung des mobilen Internets und der 5G-Konnektivität beteiligen.

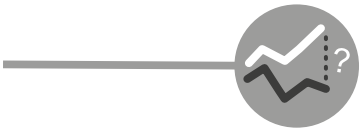
Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman China A-Share Equity Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 54930037QMZTCH4D7291

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, Energiemanagement, Umweltpolitik, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Cybersicherheitssystem und -schulungen, Qualitätsmanagement, Gesundheit und Arbeitsbedingungen und Arbeitsunfälle, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement und Preistransparenz.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Der Sub-Investment-Manager griff auf die Wesentlichkeitsmatrix von NB und lokalen Erkenntnisse zum chinesischen Markt zurück, um die wesentlichen ESG-Merkmale für chinesische A-Aktien anzupassen. Im Hinblick auf chinesische A-Aktien bewertete der Sub-Investment-Manager die langfristigen ESG-Merkmale und Werttreiber der Branchen Chinas und der darin tätigen Unternehmen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Die Methodik und die Bandbreite für den NB-ESG-Quotienten des Portfolios (mit einem speziellen Fokus auf dem chinesischen Markt) wurden während des Bezugszeitraums aktualisiert. Dies ist Teil der anhaltenden Bemühungen des Sub-Investment-Managers, die Abdeckung und Zuverlässigkeit der Daten zu verbessern.

Die nachstehend offengelegten Daten für den NB-ESG-Quotienten, die kombinierte Abdeckung und das Rating durch externe Anbieter wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechnet.

Der aktualisierte NB-ESG-Quotient verwendet ein Rating zwischen CCC und AAA, wobei CCC das niedrigste und AAA das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	AAA	CCC-AAA	96 %
Daten von Dritten	4,2	0-10	

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 33,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügt. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 91 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient	**Daten von Dritten**	**Kombinierte Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022 Bereich	CCC-AA	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2023 Bereich	CCC-AAA	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	BBB	4,0	92 %
Bezugszeitraum 2023	AAA	4,2	96 %

Wie bereits erwähnt, wurden die Methodik und die Bandbreite für den NB-ESG-Quotienten des Portfolios (mit einem speziellen Fokus auf dem chinesischen Markt) während des Bezugszeitraums aktualisiert. Dies sollte bei dem Versuch berücksichtigt werden, die Daten des Bezugszeitraums mit den Daten des Bezugszeitraums 2022 zu vergleichen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei der Datenabdeckung für einzelne im Portfolio gehaltene Unternehmen, einzelne im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Unternehmen-Rating.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das Rating externer Anbieter verbessert. Dies ist eine Folge von Änderungen der Methodik des NB-ESG-Quotienten und Verbesserungen bei der Datenabdeckung für einzelne im Portfolio gehaltene Unternehmen sowie von Handelsaktivitäten.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-23,7 %	94 %
Bezugszeitraum 2023	-33,1 %	91 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich der prognostizierte CVaR-Verlust aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios erhöht. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k.A.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit ihnen übereinstimmten), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

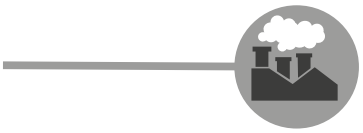
Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
KWEICHOW MOUTAI LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	8,0 %	China
MIDEA GROUP LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,1 %	China
WULIANGYE YIBIN LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,9 %	China
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECT	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,8 %	China
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,6 %	China
PING AN INSURANCE (GROUP) OF CHINA	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,5 %	China
BANK OF NINGBO LTD A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,9 %	China
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GRO	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	China
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	China
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	China
SANY HEAVY INDUSTRY LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	China
NARI TECHNOLOGY LTD A	J – Information und Kommunikation	2,3 %	China
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	China
TENCENT HOLDINGS LTD	J – Information und Kommunikation	2,1 %	China
TSINGTAO BREWERY LTD A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,0 %	China

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

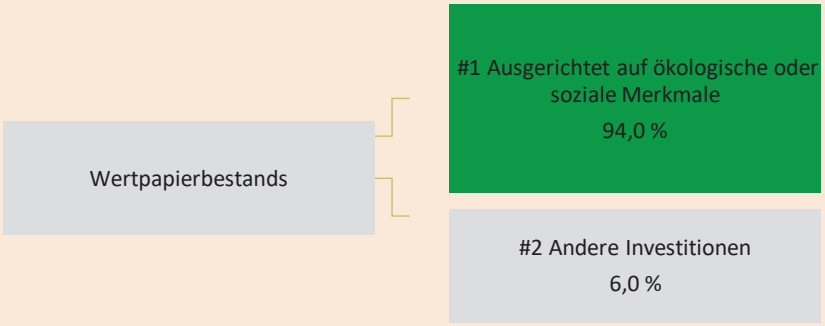
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % an Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 94,0 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 6,0 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	67,8 %
D – Energieversorgung	1,7 %
F – Baugewerbe/Bau	2,8 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,3 %
H - Verkehr und Lagerei	0,3 %
J – Information und Kommunikation	5,6 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	14,5 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,6 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,5 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

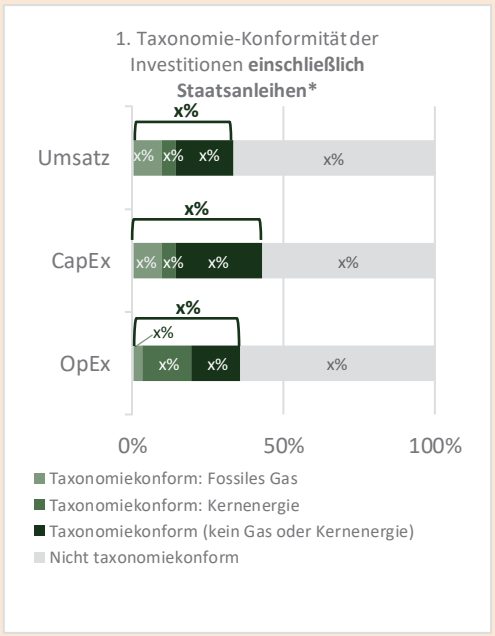
☒ Nein

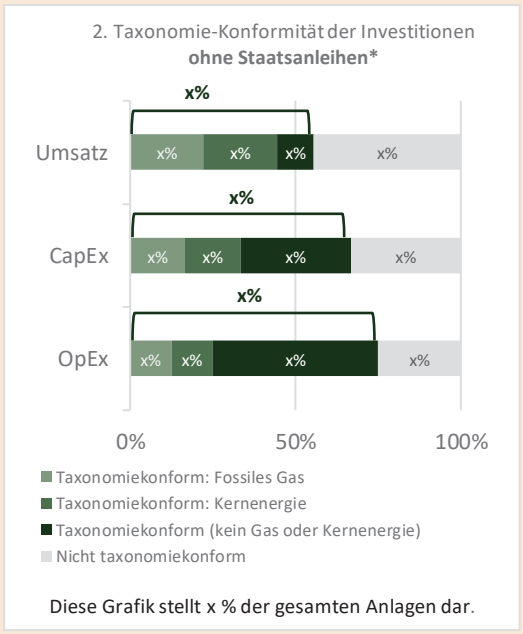
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





Diese Grafik stellt x % der gesamten Anlagen dar.

** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen lokalen Erkenntnisse zum chinesischen Markt und der ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Um die Beziehungen zu den Unternehmen aufrechtzuerhalten und zu verbessern und sicherzustellen, dass die Unternehmen ihren ESG-Kurs verfolgten, führte der Sub-Investment-Manager mit den Unternehmen einen aktiven Dialog, unabhängig davon, ob sie Kontroversen mit großen Auswirkungen oder ein schlechtes NB ESG-Quotient-Rating aufwiesen oder nicht. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman China Bond Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300I3S2HFIMB3V932

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO2-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen („**THG**") umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

- ***Soziale Merkmale***: Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	54	1-100	69 %
Daten von Dritten	4,2	0-10	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio investierte nicht in Wertpapiere von Emittenten, bei deren Aktivitäten Verstöße gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy festgestellt wurden oder die nicht mit dieser übereinstimmten, wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen in Bezug auf eine verantwortungsbewusste Geschäftsführung („**OECD** -Leitsätze"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die direkt an Kinderarbeit beteiligt waren, die in der Tabakindustrie tätig waren sowie von bestimmten Emittenten, die ein erhebliches Engagement in Ölsand haben.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	Rating der Daten durch externe Anbieter	Kombinierte Abdeckung
Bereich	1-100	0-10	0 %-100 %
Bezugszeitraum 2022	50	4,4	67 %
Bezugszeitraum 2023	54	4,2	69 %

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verschlechtert. Dies ist unter Umständen auf eine Verschlechterung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNM	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	5,5 %	China
BRIGHT FOOD (GROUP) CO LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,4 %	China
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNM	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	4,4 %	China
GUANGZHOU YUEXIU HOLDING LTD MTN	F – Baugewerbe/Bau	4,4 %	China
CHINA SOUTHERN POWER GRID CO LTD MTN	D – Energieversorgung	4,4 %	China
SHENZHEN METRO GROUP CO LTD	H - Verkehr und Lagerei	3,3 %	China
CENTRAL HUIJIN INVESTMENT LTD MTN	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,3 %	China
CHINA RESOURCES CO LTD MTN	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,3 %	China
BOC AVIATION (USA) CORPORATION MTN RegS	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,0 %	Singapur
GUANGZHOU METRO INVESTMENT FINANCE MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,8 %	China
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	China
BANK OF CHINA LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	China
CHINA POST GROUP	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	China
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNM	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,2 %	China
CENTRAL HUIJIN INVESTMENT LTD MTN	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	China

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

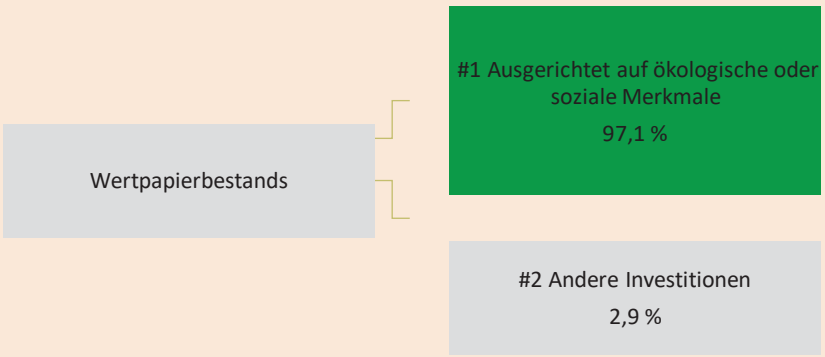
Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,1 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,9 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	13,6 %
D – Energieversorgung	8,2 %
F – Baugewerbe/Bau	6,6 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,2 %
H - Verkehr und Lagerei	4,7 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,4 %
J – Information und Kommunikation	1,7 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	37,7 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	4,9 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	17,4 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,2 %
Keine	0,3 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

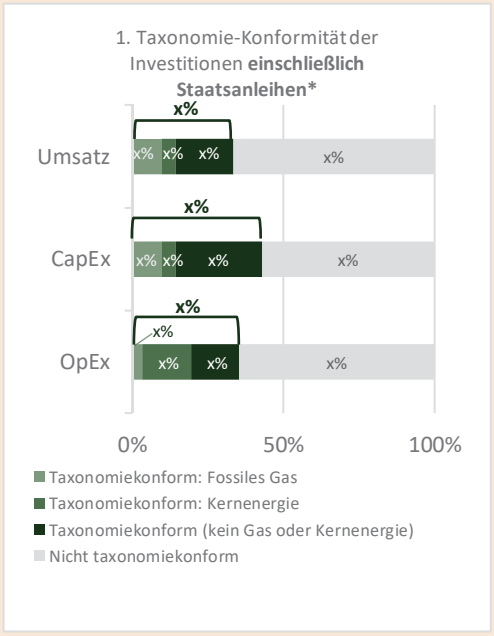
☒ Nein

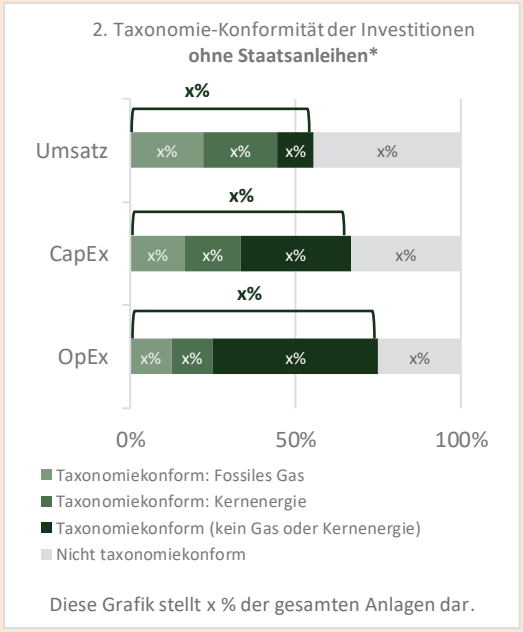
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

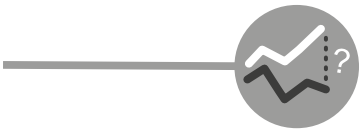
Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternenen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:
Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Climate Innovation Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 5493000I8IKJFVXLQ109

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 82,6 %* an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie here.

Das Portfolio wurde am 1. August 2023 aufgelegt und diese periodische Berichtsvorlage wurde daher auf der Grundlage des Durchschnitts der Werte zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (der „Bezugszeitraum“) erstellt.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

Ökologische Merkmale: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

Zwecks der Ausrichtung des Portfolios auf ein Netto-Null-Ziel beabsichtigt der Sub-Investment-Manager bis 2030 mindestens 90 % des Nettoinventarwerts des Portfolios in Unternehmen mit von der Science-Based Target Initiative („**SBTi**")[1] validierten Zielen (oder gleichwertigen Zielen gemäß der Net-Zero-Sector-Alignment-Methode von Neuberger Berman, die mit den Zielvorgaben des IIGCC übereinstimmt)[2] zu investieren und bis 2050 100 % des Nettoinventarwerts des Portfolios zu erreichen. Darüber hinaus muss das Portfolio seinen CO2-Fußabdruck in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-THG-Emissionen[3] um mindestens 30 % bis 2030 im Vergleich zum Basisjahr 2019 reduzieren und einen anschließenden Rückgang auf Null netto bis 2050 erreichen. Das Basisjahr 2019 kann neu berechnet werden, wenn sich die Datenqualität und die Offenlegung im Laufe der Zeit verbessern, insbesondere in Bezug auf die Scope-3-Emissionen. Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Soziale Merkmale: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen

[1] Die Science Based Targets initiative (SBTi) ist eine Partnerschaft zwischen dem Carbon Disclosure Project (CDP), dem Globalen Pakt der Vereinten Nationen (UNGC), dem Weltressourceninstitut (WRI) und dem World Wide Fund for Nature, die es Unternehmen ermöglicht, wissenschaftlich fundierte Emissionsreduktionsziele festzulegen.

[2] The Institutional Investors Group on Climate Change (IGCC) hat das Net Zero Investment Framework geschaffen, um Vermögensbesitzern und Vermögensverwaltern bei der Entwicklung von Netto-Null-Investitionsstrategien oder der Erfüllung von Netto-Null-Verpflichtungen zu unterstützen. Die Zielvorgaben der IIGCC formen eine Komponente des Net Zero Investment Framework.

[3] Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Kalenderquartals berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	ES:B G: 2,7	ES: A-D G: 1-4	96 %
Rating der Daten durch externe Anbieter	6,8	0-10	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 9,5 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 96 %, was einem ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit". Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;

- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und

- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem zum dritten und vierten Kalenderquartalsende des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NVENT ELECTRIC PLC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	6,10 %	USA
GFL ENVIRONMENTAL SUBORDINATE VOTI	E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	5,97 %	Kanada
PROCORE TECHNOLOGIES INC	J – Information und Kommunikation	5,61 %	USA
QUANTA SERVICES INC	F – Baugewerbe/Bau	5,29 %	USA
HOWMET AEROSPACE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,27 %	USA
TRANE TECHNOLOGIES PLC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,16 %	USA
DSM FIRMENICH AG	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,69 %	Schweiz
INGERSOLL RAND INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,60 %	USA
STELLANTIS NV	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,38 %	USA
HITACHI LTD	J – Information und Kommunikation	3,11 %	Japan
BUREAU VERITAS SA	M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	3,00 %	Frankreich
GREEN PLAINS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,77 %	USA
BYD LTD H	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,57 %	China
XYLEM INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,38 %	USA
IBERDROLA SA	D – Energieversorgung	2,32 %	Spanien

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

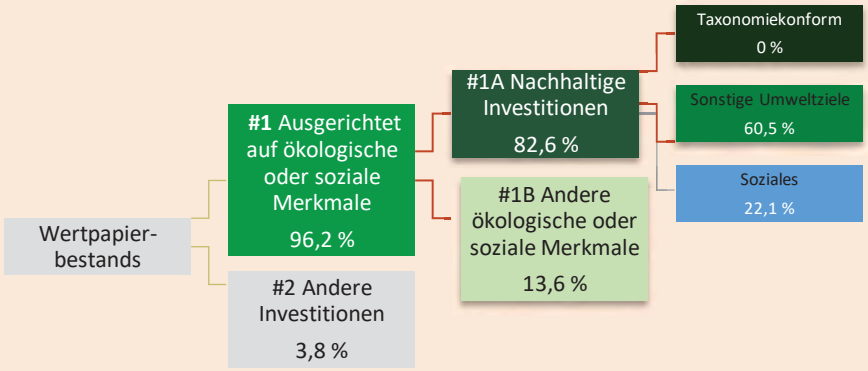
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,2 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 50 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 82,6 % an nachhaltigen Investitionen.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,8 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Kalenderquartals berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende des dritten und vierten Kalenderquartals berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	64,4 %
D – Energieversorgung	2,4 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	7,5 %
F – Baugewerbe/Bau	5,8 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,0 %
H - Verkehr und Lagerei	1,8 %
J – Information und Kommunikation	12,9 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	3,1 %

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[4]?

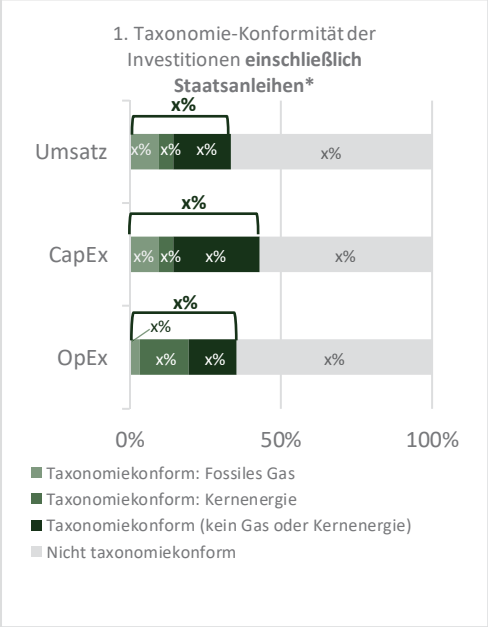
- ☐ Ja:
  - ☐ In fossiles Gas
  - ☐ In Kernenergie
- ☒ Nein

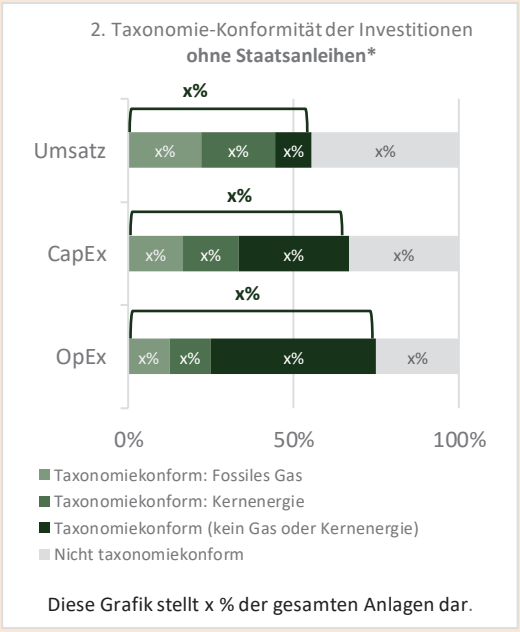
[4] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 60,5 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 22,1 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, die an Technologien und/oder Aktivitäten im Zusammenhang mit der Klima-Innovation beteiligt sind oder davon profitieren.

Der Sub-Investment-Manager nutzte den NB-ESG-Quotienten und eine Bewertung der thematischen Reinheit zwecks Identifikation von Unternehmen, die im Bereich des langfristigen Trends der Klimainnovation operieren. Beteiligungen mit thematischer Reinheit werden als solche definiert, bei denen mindestens 50 % des zusätzlichen Gewinn-/Umsatzwachstums oder der Investitionsausgaben auf Aktivitäten im Zusammenhang mit der Klimainnovation ausgerichtet sind.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

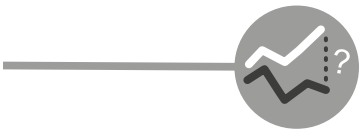
II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Corporate Hybrid Bond Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300TMYI9EFR4Q1G47

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 36,2 %* an nachhaltigen Investitionen**
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

**Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements bei nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**"). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des

Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	59	1-100	100 %
Daten von Dritten	7,3	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch den Durchschnitt der Daten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet, wobei für die Bewertung des NB-ESG-Quotienten ein Rating zwischen 1 und 100 verwendet wird, wobei 1 die niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,4 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 56 %, was einem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Seit dem 6. Dezember 2023 verbietet der Sub-Investment-Manager ebenfalls den Kauf von Wertpapieren von Unternehmen, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt sind. Dies schloss auch Unternehmen ein, die Rohtabakblätter anbauten oder verarbeiteten.
Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	Rating der Daten durch externe Anbieter	Kombinierte Abdeckung
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	58	6,9	96 %
Bezugszeitraum 2023	59	7,3	100 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. CVaR

	CVaR	Abdeckung
Bezugszeitraum 2022	-5,2 %	41 %
Bezugszeitraum 2023	-5,4 %	56 %

Die CVaR-Prognose hat sich im Vergleich zum Vorjahr aufgrund von einer verbesserten Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten sowie Handelsaktivitäten im Portfolio verändert.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es während des Bezugszeitraums kein nachhaltiges Anlageziel. Seit dem 2. August 2023 hat sich das

Portfolio dazu verpflichtet, mindestens 10 % nachhaltige Investitionen zu halten. Die nachhaltigen Investitionen bewarben die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Seit dem 2. August 2023 wendet der Sub-Investment-Manager seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen übereinstimmen, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NGG FINANCE PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	7,1 %	Großbritannien
ELECTRICITE DE FRANCE SA MTN RegS	D – Energieversorgung	4,9 %	Frankreich
SOUTHERN ELECTRIC GENERATING CO	D – Energieversorgung	4,6 %	USA
VODAFONE GROUP PLC $60NC6 MTN RegS	J – Information und Kommunikation	4,3 %	Großbritannien
CENTRICA PLC RegS	D – Energieversorgung	4,0 %	Großbritannien
ENBRIDGE INC	H - Verkehr und Lagerung	3,3 %	Kanada
ENBW ENERGIE BADEN WUERTTEMBER NC7 RegS	D – Energieversorgung	2,7 %	Deutschland
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA NC5.5 RegS	E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	2,5 %	Frankreich
BAYER AG RegS		2,4 %	Deutschland
BP CAPITAL MARKETS PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,3 %	Großbritannien
FIRMENICH INTERNATIONAL SA RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,3 %	Schweiz
AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD RegS	D – Energieversorgung	2,3 %	Australien
BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC RegS	J – Information und Kommunikation	2,2 %	Großbritannien
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE N RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,1 %	Deutschland
ELIA GROUP SA RegS	D – Energieversorgung	1,9 %	Belgien

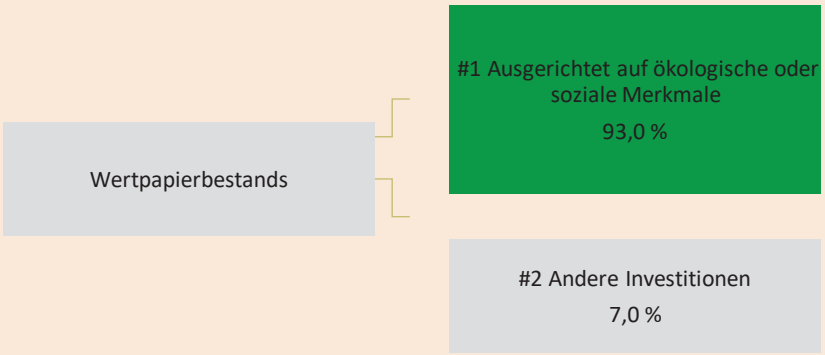
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 93,0 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in diesem regelmäßigen Bericht wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts der Werte zum dritten und vierten Quartalsende 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 36,2 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 7,0 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum für die nachstehenden Daten ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden 2023, mit Ausnahme der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen. In diesem Falle wurden die Daten für diesen Bezugszeitraum lediglich auf Grundlage der Portfoliobeteiligungen zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 erstellt.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 betrug 36,2 %.

Darin enthalten waren 35,7 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, und 0,5 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögens-werte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,0 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	14,2 %
D – Energieversorgung	36,1 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	5,5 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,0 %
H - Verkehr und Lagerei	3,8 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,0 %
J – Information und Kommunikation	14,8 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	22,5 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,0 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,0 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,0 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,0 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,0 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,0 %
Keine	0,0 %

O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

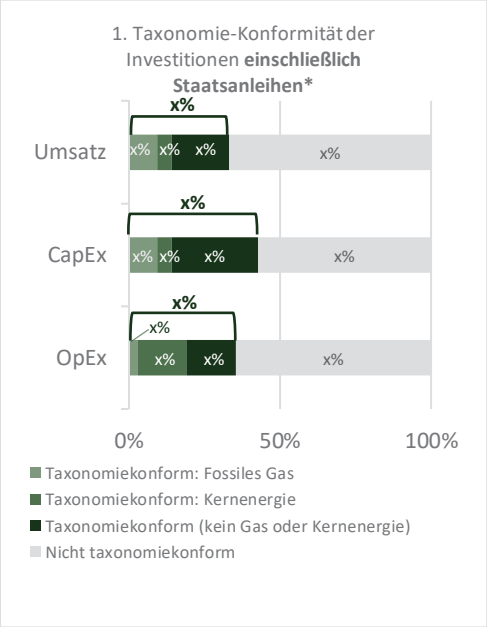
☒ Nein

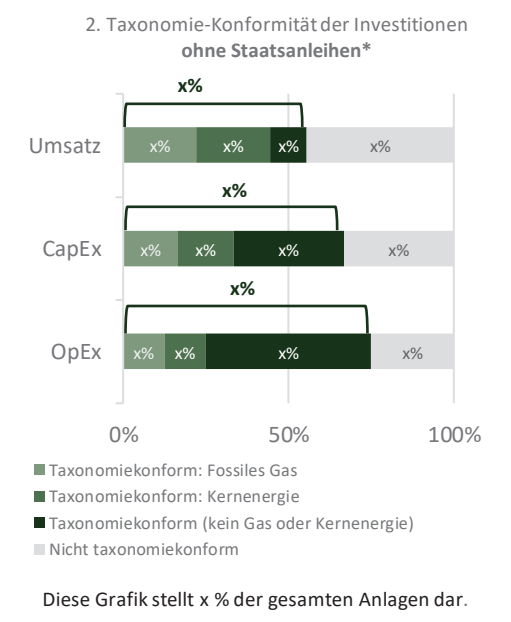
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





Diese Grafik stellt x % der gesamten Anlagen dar.

** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 35,7 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 0,5 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternenen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

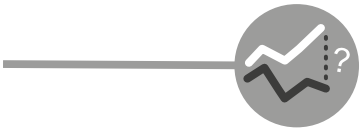
II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Developed Market FMP – 2027 (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300GF7EOMWXAHXG64

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Das Portfolio wurde am 31. Juli 2023 aufgelegt und diese periodische Berichtsvorlage wurde daher auf der Grundlage des Durchschnitts der Werte zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (der „Bezugszeitraum“) erstellt.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Angesichts des Anlageziels, der Anlagedauer und des Fälligkeitsdatums am 31. Juli 2027 (das „**Fälligkeitsdatum**“) war der Portfolioumschlag begrenzt. Obwohl das Portfolio während seiner gesamten Lebensdauer ökologische und soziale Merkmale bewerben wird, konzentrierte sich die Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale auf die Aufbauphase des Portfolios.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	60	1-100	100 %
Daten von Dritten	6,4	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 10,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 83 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

Da das Portfolio darauf abzielte, eine Rendite über eine bestimmte Laufzeit zu erzielen, die am Fälligkeitsdatum endet, war der Portfolioumschlag begrenzt.

- ***… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?***

Nicht zutreffend – dies ist der erste Bezugszeitraum.

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem über die vier Kalenderquartalsenden des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitt basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
FORD MOTOR CREDIT COMPANY LLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,5 %	USA
AIR LEASE CORPORATION	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,4 %	USA
SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,4 %	Großbritannien
AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCA	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,4 %	Irland
LLOYDS BANKING GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,4 %	Großbritannien
MORGAN STANLEY MTN	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,3 %	USA
HSBC HOLDINGS PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,3 %	Großbritannien
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,3 %	USA
PRIME SECURITY SERVICES BORROWER L RegS	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,3 %	USA
BPCE SA MTN 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	Frankreich
CAPITAL ONE FINANCIAL CORPORATION	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	USA
MICRON TECHNOLOGY INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,2 %	USA
IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	Großbritannien
BNP PARIBAS 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,1 %	Frankreich
STELLANTIS FINANCE US INC 144A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,0 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

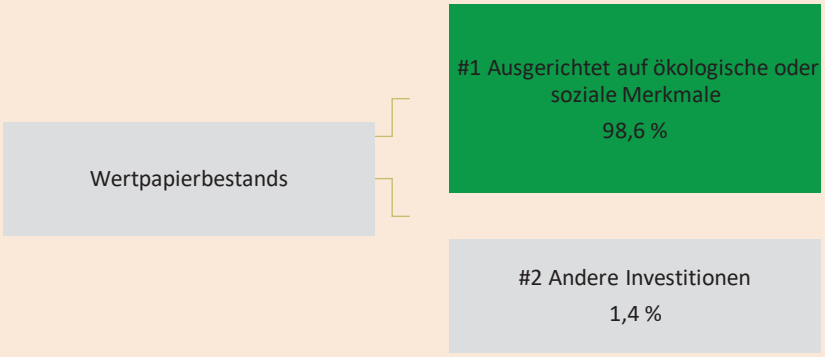
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 98,6 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 1,4 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	3,1 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	15,6 %
D – Energieversorgung	4,5 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,3 %
H - Verkehr und Lagerei	11,0 %
J – Information und Kommunikation	10,2 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	43,0 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,1 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	7,1 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	2,0 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,2 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

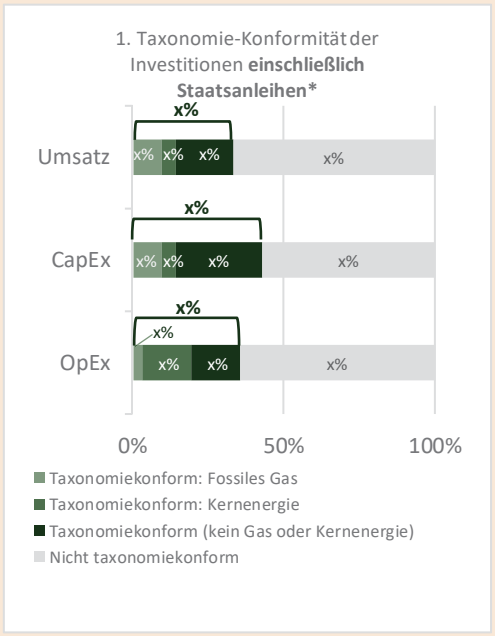
☒ Nein

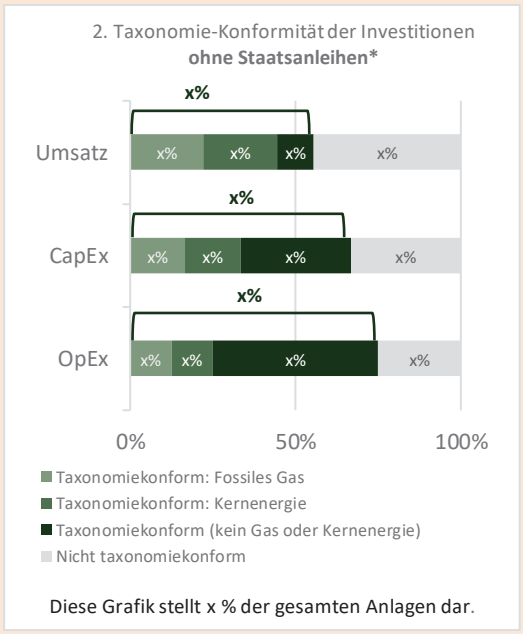
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





Diese Grafik stellt x % der gesamten Anlagen dar.

** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

In Anbetracht des Anlageziels, der Anlagedauer und des Fälligkeitstermins des Portfolios werden zwar während der gesamten Laufzeit des Portfolios ökologische und soziale Merkmale beworben, doch konzentrierte sich die Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale auf die Aufbauphase des Portfolios, da es die Absicht des Sub-Investment-Manager war, einen geringen Portfolioumschlag zu haben.

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

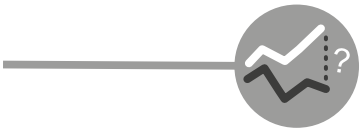
Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager erachtete diese Zusammenarbeit mit Emittenten als wichtigen Bestandteil seines Anlageprozesses, der es ihm ermöglichte sicherzustellen, dass die erstmalige Beurteilung des Emittenten (bei Auflage) weiterhin zutreffend war und in die laufende Bewertung durch das NB-ESG-Quotient-Rating einfloss. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300M7KHGG3BTZ3979

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen (**„THG"**) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.

- ***Soziale Merkmale***: Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, **„SDGs"**), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO_2-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

- ***Soziale Merkmale:*** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.
   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	52	1-100	97 %
Daten von Dritten	3,9	0-10	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio investiert nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen erzielten. Emittenten, die an direkter Kinderarbeit beteiligt waren, und Emittenten, die mehr als 10 % der Umsätze aus der Ölsandgewinnung erzielten, wurden ebenfalls ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0 %-100 %
Bezugszeitraum 2022	51	3,8	96 %
Bezugszeitraum 2023	52	3,9	97 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**"), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**") (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**"):

Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
Teil 2 – staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 - THG-Emissionsintensität
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC RegS	H - Verkehr und Lagerei	2,2 %	Aserbaidschan
ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,0 %	Argentinien
PETROLEOS MEXICANOS	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,7 %	Mexiko
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,6 %	Mexiko
EL SALVADOR REPUBLIC OF (GOVERNMEN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,4 %	El Salvador
OMAN GOVERNMENT BOND MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,4 %	Oman
ANGOLA GOVERNMENT BOND RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,3 %	Angola
ECUADOR REPUBLIC OF (GOVERNMENT) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,3 %	Ecuador
DOMINICAN REPUBLIC (GOVERNMENT) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,3 %	Dominikanisch Republik
COTE D IVOIRE REPUBLIC OF RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	Elfenbeinküste
NK KAZMUNAYGAZ AO RegS	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,2 %	Kasachstan
SERBIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	Republik Serbi
QATAR GOVERNMENT BOND RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	Katar
ROMANIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	Rumänien
STATE OIL CO OF THE AZERBAIJAN REP RegS	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,2 %	Aserbaidschan

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

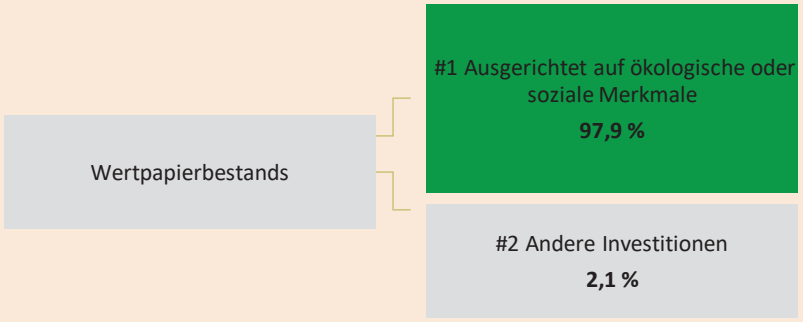
Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen" erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,1 % an „sonstigen Investitionen".

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	8,9 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,9 %
D – Energieversorgung	3,4 %
E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,0 %
F – Baugewerbe/Bau	0,1 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,2 %
H - Verkehr und Lagerei	3,0 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,0 %
J – Information und Kommunikation	0,3 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	11,4 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,3 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,1 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	65,1 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,0 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,5 %
Keine	1,7 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

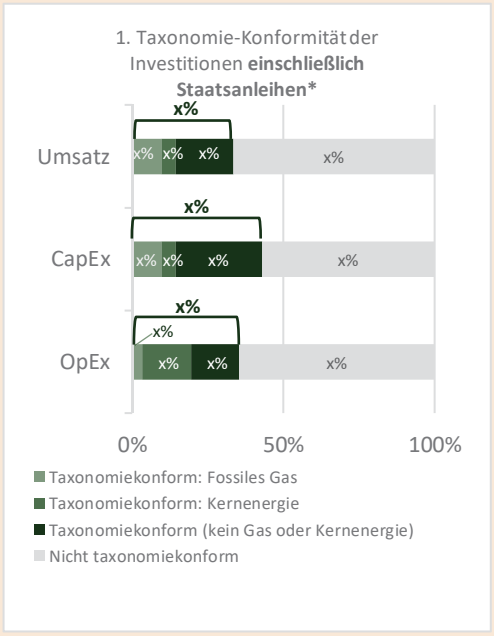
☒ Nein

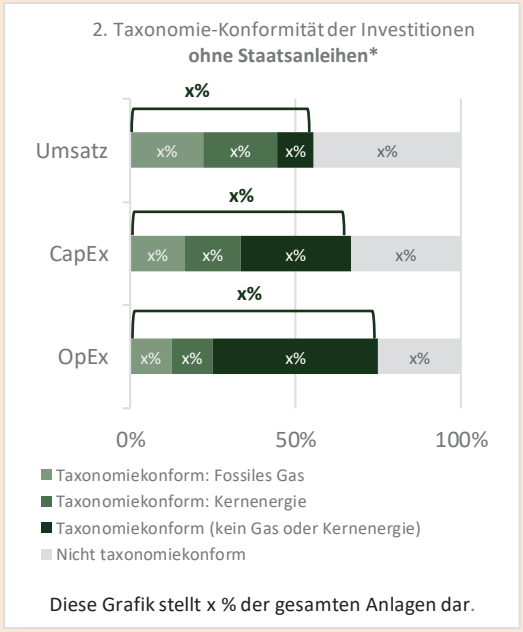
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





Diese Grafik stellt x % der gesamten Anlagen dar.

** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Emerging Market Debt – Local Currency Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300VLRPBFFXL0DB81

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ Ja	☒ Nein
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen (**„THG"**) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.

- ***Soziale Merkmale***: Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, **„SDGs"**), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale:*** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO2-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

- ***Soziale Merkmale:*** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik**.**

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.
   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	55	1-100	97 %
Daten von Dritten	4,8	0-10	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Die vom Portfolio gehaltenen Investitionen waren nicht in Wertpapieren von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen erzielten. Emittenten, die an direkter Kinderarbeit beteiligt waren, und Emittenten, die mehr als 10 % der Umsätze aus der Ölsandgewinnung erzielten, wurden ebenfalls ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

- ***… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?***

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0 %-100 %
Bezugszeitraum 2022	54	4,8	96 %
Bezugszeitraum 2023	55	4,8	97 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter blieb im Vergleich zum Vorjahr unverändert.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**"), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**") (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**"):

Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
Teil 2 – staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 - THG-Emissionsintensität
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,5 %	Südafrika
MEX BONOS DE DESARROLLO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,2 %	Mexiko
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,2 %	Mexiko
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,1 %	Südafrika
COLOMBIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,7 %	Kolumbien
POLAND GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,7 %	Polen
TITULOS DE TESORERIA B	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,7 %	Kolumbien
POLAND (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,6 %	Polen
INDONESIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,5 %	Indonesien
CZECH REPUBLIC RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,5 %	Tschechische Republik
MALAYSIA GOVERNMENT	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,4 %	Malaysia
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,4 %	Südafrika
INDONESIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,3 %	Indonesien
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	Mexiko
CZECH REPUBLIC RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	Tschechische Republik

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

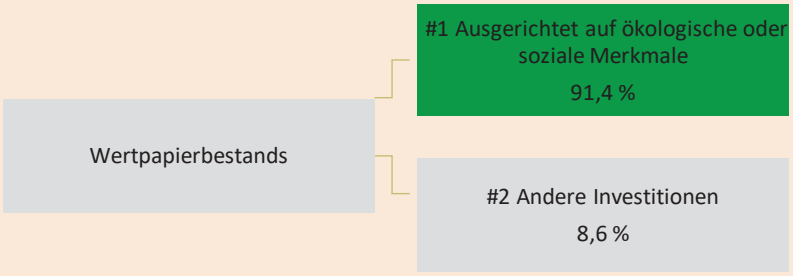
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 91,4 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 8,6 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Mittelwerts aus dem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,2 %
D – Energieversorgung	2,1 %
F – Baugewerbe/Bau	0,1 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,1 %
H - Verkehr und Lagerei	0,1 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,0 %
J – Information und Kommunikation	0,0 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,7 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,1 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	92,4 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,0 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,4 %
Keine	1,0 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

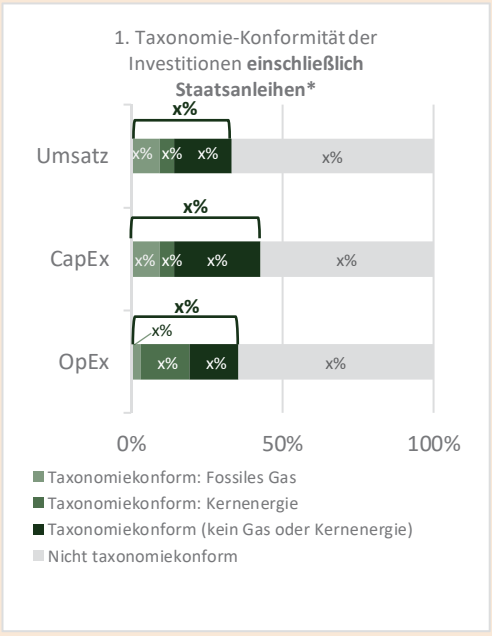
☒ Nein

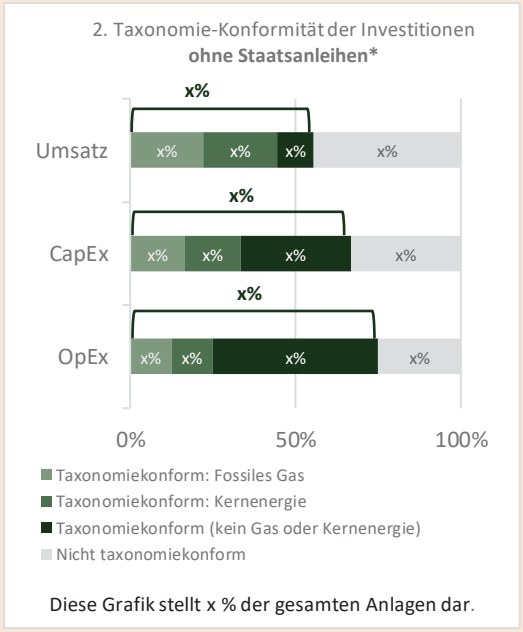
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





Diese Grafik stellt x % der gesamten Anlagen dar.

** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

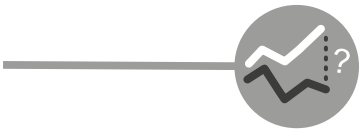
II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Emerging Market Debt Blend Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300JASQ1JIDYO8X22

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen (**„THG“**) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.

- ***Soziale Merkmale***: Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, **„SDGs“**), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO_2-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

- ***Soziale Merkmale:*** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	55	97 %
Daten von Dritten	4,7	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Seit dem 6. Dezember 2023 schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellten oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie haben. Das Portfolio hat Wertpapiere von Unternehmen ausgeschlossen, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielt haben. Das Portfolio investierte nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen erzielten. Emittenten, die an direkter Kinderarbeit beteiligt waren, und Emittenten, die mehr als 10 % der Umsätze aus der Ölsandgewinnung erzielten, wurden ebenfalls ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

- ***… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?***

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	54	4,6	95 %
Bezugszeitraum 2023	55	4,7	97 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet waren der Manager und der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**"), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**") (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**"):

Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
Teil 2 – staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 - THG-Emissionsintensität
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,5 %	Südafrika
TITULOS DE TESORERIA B	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,5 %	Kolumbien
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	Mexiko
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,0 %	Südafrika
POLAND GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,0 %	Polen
MEX BONOS DE DESARROLLO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,0 %	Mexiko
INDONESIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,0 %	Indonesien
THAILAND KINGDOM OF (GOVERNMENT)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,9 %	Thailand
SOUTH AFRICA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,8 %	Südafrika
COLOMBIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,7 %	Kolumbien
FONDO MIVIVIENDA SA RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,7 %	Peru
EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP RegS	D – Energieversorgung	0,7 %	Kolumbien
POLAND (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,7 %	Polen
CZECH REPUBLIC RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,7 %	Tschechische Republik
INDONESIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,7 %	Indonesien

**O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

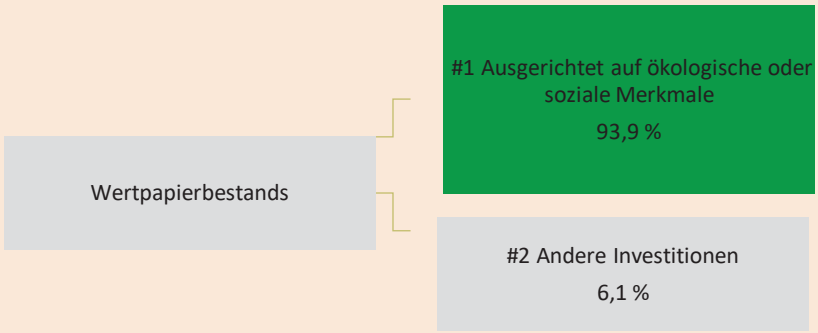
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 93,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 6,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen

Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Steine & Erden	4,9 %
C – Fertigung	3,7 %
D – Energieversorgung	4,2 %
F – Baugewerbe/Bau	0,4 %
G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,8 %
H – Transport und Lagerung	1,5 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,3 %
J – Information und Kommunikation	1,3 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	15,4 %
L – Immobilienaktivitäten	0,2 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	0,1 %
N – Verwaltungs- und Unterstützungsdienstleistungen	0,5 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	64,6 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,6 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,5 %
Keine	1,0 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

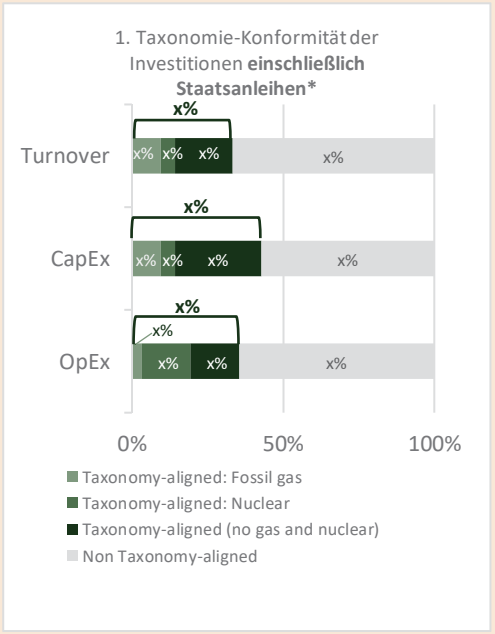
☒ Nein

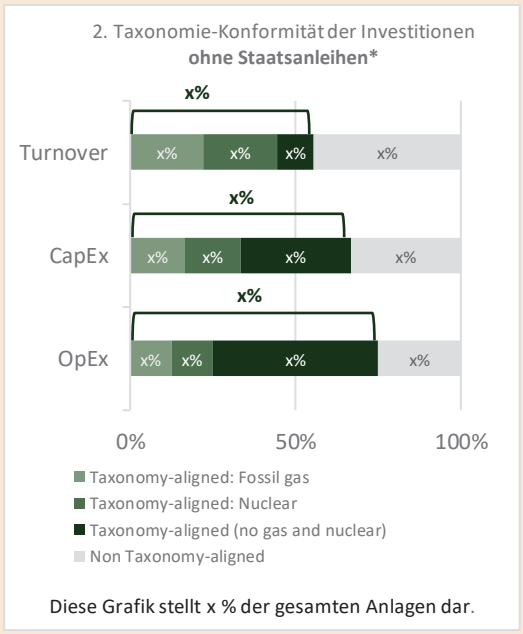
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





Diese Grafik stellt x % der gesamten Anlagen dar.

** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternenen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

k.A.

Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?

k.A.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

k.A.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?

k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Emerging Market Debt Sustainable Investment Grade Blend (das „**Portfolio**“).

Unternehmenskennung: 549300IFJK0FPOE1X496

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 58.6 %* an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen (**„THG“**) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.

- ***Soziale Merkmale***: Fortschritte bei der Verwirklichung der UN-Ziele einer nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „**SDGs“**), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO_2-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

- ***Soziale Merkmale:*** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarben und bewerben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO2-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-THG-Emissionen.[1] Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

[1]Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanz-produkt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Das Portfolio hat nicht in Emittenten investiert, die im Hinblick auf den NB-ESG-Quotienten im unteren Quartil rangieren und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen besteht.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	57	1-100	99 %
Daten von Dritten	4,8	0-10	

   Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

   Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

   Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

   Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

   Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar

waren. Seit dem 6. Dezember 2023 schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellten oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie haben. Das Portfolio hat Wertpapiere von Unternehmen ausgeschlossen, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielt haben. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten aus dem Anlageuniversum aus, die in der Pelzherstellung, im Glücksspiel oder im Bereich Kernkraft tätig sind. Seit dem 2. August 2023 haben weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager Investitionen in Schuldtiteln noch in Geldmarktinstrumente von staatlichen Emittenten und/oder in Unternehmen getätigt, bei denen der Manager und der Sub-Investment-Manager eine schwache ESG-Praxis festgestellt haben. Diese Ausschlüsse basierten auf einer Reihe von ESG-Kriterien, darunter:

- Staatliche Emittenten, die auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten im untersten Dezil rangierten und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen bestanden; oder
- Staatliche Emittenten, die aufgrund von ESG-Erwägungen aus dem J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index (Total Return, USD) ausgeschlossen wurden; oder
- staatliche Emittenten, deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat aufgrund von Menschenrechtsverletzungen mit Sanktionen belegt wurden; oder
- Staatliche Emittenten, bei denen eine hohe und steigende THG-Emissionsintensität festgestellt wurde; oder
- Staatliche Emittenten, bei denen schlechte und sich verschlechternde Kennzahlen für Menschenrechte und Rechtsstaatlichkeit festgestellt wurden; oder
- staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht einhielten, oder staatliche Emittenten, die von der Financial Action Task Force („FATF") als Hochrisikoland eingestuft wurden.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	56	4,8	97 %
Bezugszeitraum 2023	57	4,8	99 %

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert, und das Rating der Daten externer Anbieter ist unverändert geblieben. Dies ist auf Verbesserungen bei im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartige Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („**SDGs**“).

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wandten ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Bei der Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Anlagen kein ökologisches oder soziales nachhaltiges Anlageziel erheblich beeinträchtigten, berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für staatliche Emittenten (wie nachfolgend in Teil 2 der Tabelle im Abschnitt „*Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*“ dargelegt) (die „**staatlichen PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle

Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit". Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

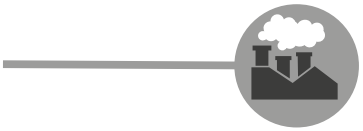
Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

I. Wie oben unter „Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs und staatlichen PAIs berücksichtigt.

II. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“) aufgeführt sind:

Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind

Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
Teil 2 – staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 - THG-Emissionsintensität
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
THAILAND KINGDOM OF (GOVERNMENT)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,1 %	Thailand
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNM	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,1 %	China
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNM	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,9 %	China
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,8 %	Mexiko
INDONESIA REPUBLIC OF	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,8 %	Indonesien
INDONESIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,8 %	Indonesien
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,7 %	Mexiko
ROMANIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,7 %	Rumänien
PANAMA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,6 %	Panama
PERU THE REPUBLIC OF	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,6 %	Peru
MALAYSIA GOVERNMENT	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,6 %	Malaysia
INDONESIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,6 %	Indonesien
MEX BONOS DE DESARROLLO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,6 %	Mexiko
UNITED MEXICAN STATES	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,6 %	Mexiko
KAZAKHSTAN GOVERNMENT BOND MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,6 %	Kasachstan

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

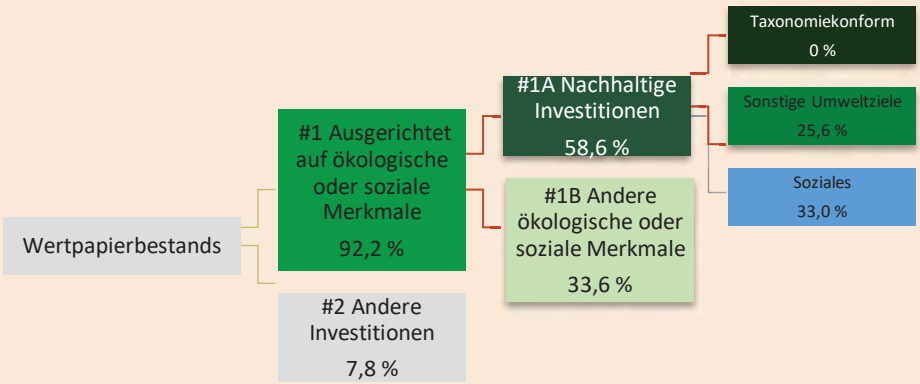
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 92,2 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtete sich, mindestens 50 % nachhaltige Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums 2023 hielt das Portfolio 58,6 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 7,8 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:
- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögens-werte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,5 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,3 %
D – Energieversorgung	0,4 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,7 %
H - Verkehr und Lagerei	1,2 %
J – Information und Kommunikation	1,1 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	8,3 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	82,1 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	2,0 %
Keine	0,4 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[2]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

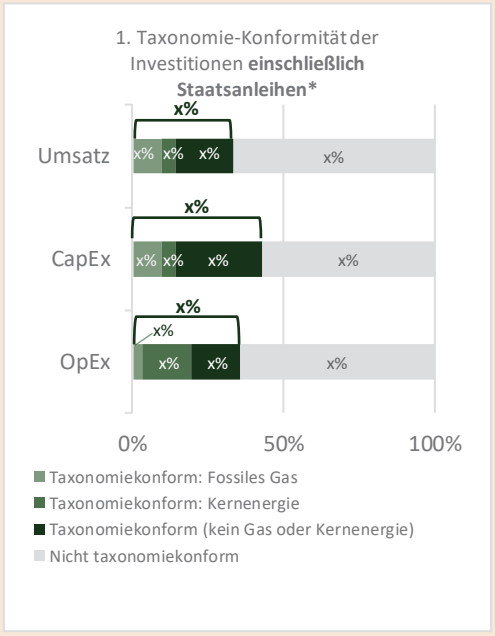
☒ Nein

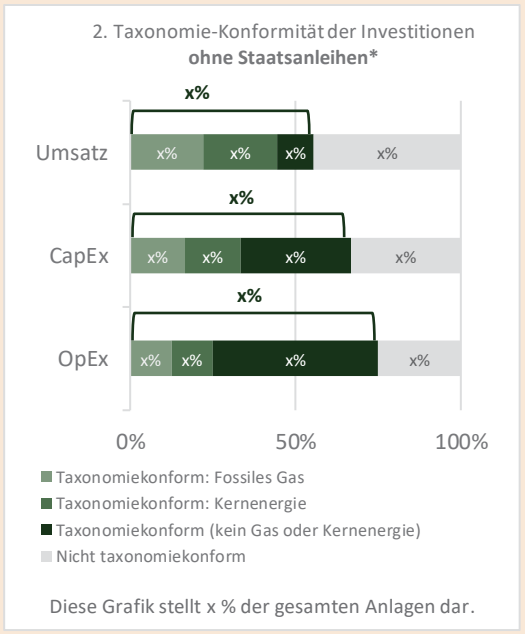
[2] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 25,6 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 33,0 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

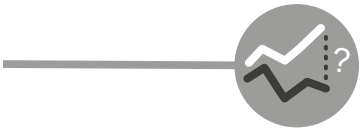
II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Emerging Markets Equity Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300XPW2SIPQYGFT52

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

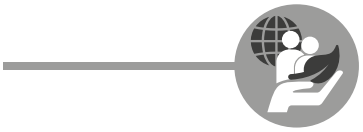
☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?



Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zur Gesundheitsversorgung, Datenschutz und -sicherheit, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsstandards in den Lieferketten.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor in den Schwellenländern angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen in Schwellenländern im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Durch die Integration lokaler Erkenntnisse in die globale Wesentlichkeitsmatrix von NB nutzte der Sub-Investment-Manager die globale Wesentlichkeitsmatrix von NB und passte die wesentlichen ESG-Merkmale an, um sicherzustellen, dass sie den Schwellenländern Rechnung trugen. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB berücksichtigte die langfristigen ESG-Merkmale umfassend, welche die Entwicklung der Branchen und Unternehmen in den Schwellenländern betrafen, und identifizierte Unternehmen, die in den Schwellenländern als Werttreiber fungierten.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,7	ES: A-D G: 1-4	90 %
Daten von Dritten	5,9	0-10	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.
.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 29,6 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 90 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	ES: B G: 2,0	5,6	95 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B G: 2,7	5,9	90 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verschlechtert und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung des NB-ESG-Quotienten und des externen Ratings aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verlagert.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-28,8 %	91 %
Bezugszeitraum 2023	-29,6 %	90 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k.A.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**"):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	8,1 %	Taiwan (Republik China)
SAMSUNG ELECTRONICS LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,8 %	Repbulik Korea
TENCENT HOLDINGS LTD	J – Information und Kommunikation	5,0 %	China
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,5 %	China
ICICI BANK LTD	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	Indien
SK HYNIX INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,1 %	Repbulik Korea
RELIANCE INDUSTRIES LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,5 %	Indien
INDUSIND BANK LTD	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,5 %	Indien
HDFC BANK LTD	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,4 %	Indien
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,3 %	Taiwan (Republik China)
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,2 %	Indien
LG CHEM LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,2 %	Repbulik Korea
BID CORPORATION LTD	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,2 %	Südafrika
RIO TINTO PLC	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,2 %	Australien
PETROLEO BRASILEIRO PREF SA	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,1 %	Brasilien

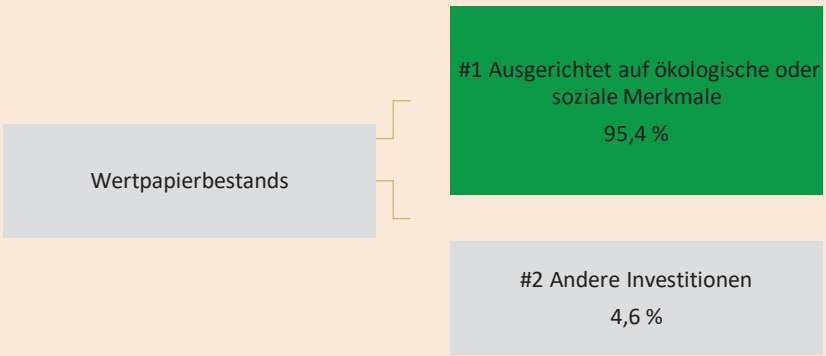
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögens-werten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 95,4 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,6 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	4,7 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	42,2 %
D – Energieversorgung	0,4 %
F – Baugewerbe/Bau	1,4 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	10,1 %
H - Verkehr und Lagerei	0,8 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	2,6 %
J – Information und Kommunikation	9,4 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	22,9 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,3 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,9 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,1 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,8 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,4 %
Keine	0,9 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

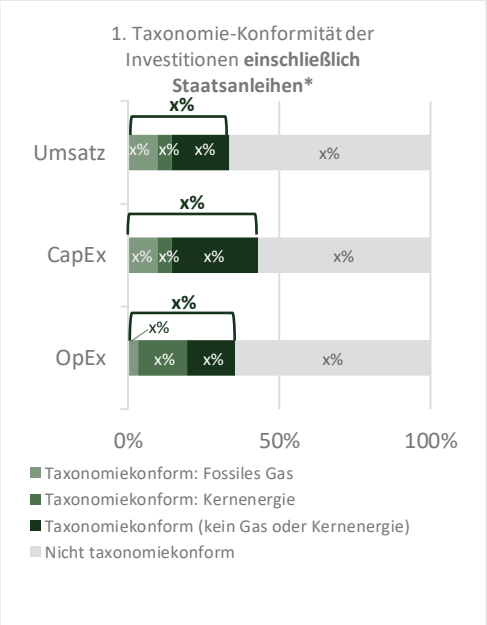
☒ Nein

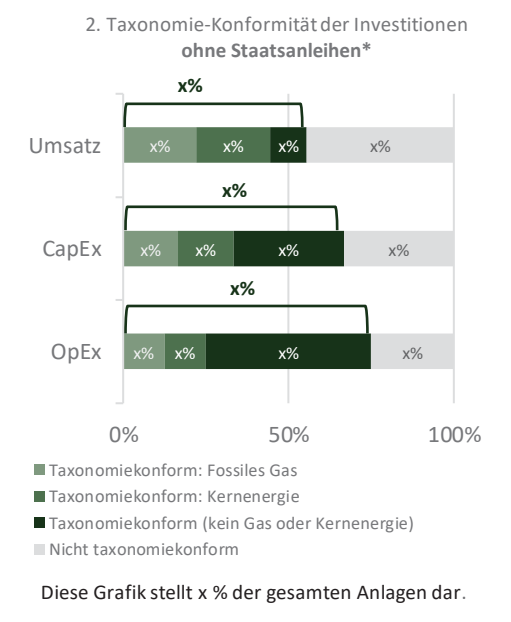
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





Diese Grafik stellt x % der gesamten Anlagen dar.

** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Um die Beziehungen zu den Unternehmen aufrechtzuerhalten und zu verbessern und sicherzustellen, dass die Unternehmen ihren ESG-Kurs verfolgten, führte der Sub-Investment-Manager mit den Unternehmen einen aktiven Dialog, unabhängig davon, ob sie Kontroversen mit großen Auswirkungen oder ein schlechtes NB ESG-Quotient-Rating aufwiesen oder nicht. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Euro Bond Fund (das „**Portfolio**“)*

Unternehmenskennung: 549300TQ5M6FBE2H8T74

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Mit Wirkung vom 6. Dezember 2023 änderte der Neuberger Berman Euro Opportunistic Bond Fund seinen Namen in Neuberger Berman Euro Bond Fund.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	65	1-100	95 %
Daten von Dritten	6,3	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 3,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt

für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 16 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Außerdem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Ferner durften für das Portfolio keine Wertpapiere von Emittenten gekauft werden, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	66	6,0	90 %
Bezugszeitraum 2023	65	6,3	95 %

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-5,4 %	12 %
Bezugszeitraum 2023	-3,1 %	16 %

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**"), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**") (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**"):

Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
Teil 2 – staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 - THG-Emissionsintensität
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („**NACE**“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
PORTUGAL (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,59 %	Portugal
NETHERLANDS (KINGDOM OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,83 %	Niederlande
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,69 %	Italien
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,66 %	Deutschland
FRANCE (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,42 %	Frankreich
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,31 %	Italien
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,23 %	Italien
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,22 %	Italien
AMCO ASSET MANAGEMENT COMPANY SPA RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,14 %	Italien
EUROPEAN UNION RegS	U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,09 %	Supranational
SOUTHERN ELECTRIC GENERATING CO	D – Energieversorgung	1,07 %	USA
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHER	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,06 %	Israel
GLOBAL PAYMENTS INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,03 %	USA
EUROPEAN UNION RegS	U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,02 %	Supranational
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,02 %	Polen

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

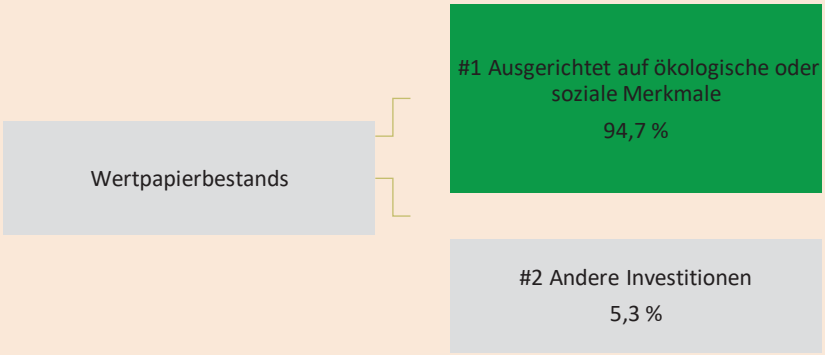
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 94,7 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 5,3 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,2 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,8 %
D – Energieversorgung	4,5 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,8 %
J – Information und Kommunikation	1,6 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	33,7 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	5,3 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,3 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,0 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	41,8 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,3 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	6,8 %
Keine	0,9 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

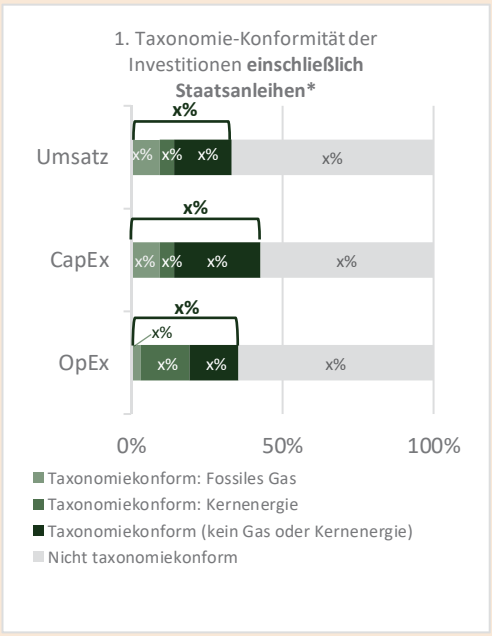
☒ Nein

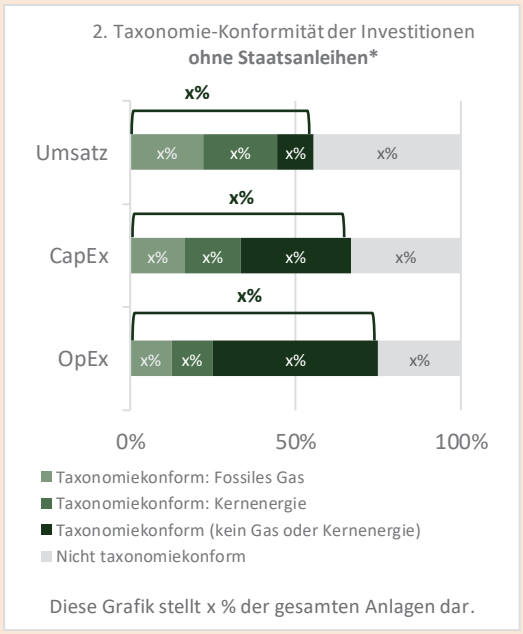
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

  .

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternenen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

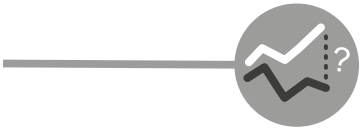
II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Euro Bond Absolute Return Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300ZPJNN43P39QR29

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie here.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	65	97 %
Daten von Dritten	6,8	

Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,4 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 21 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Ferner durften für das Portfolio keine Wertpapiere von Emittenten gekauft werden, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	66	6,5	94 %
Bezugszeitraum 2023	65	6,8	97 %

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. CVaR

	CVaR	Abdeckung
Bezugszeitraum 2022	-5,0 %	17 %
Bezugszeitraum 2023	-5,4 %	21 %

Die CVaR-Prognose hat sich im Vergleich zum Vorjahr aufgrund von einer verbesserten Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten sowie Handelsaktivitäten im Portfolio verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

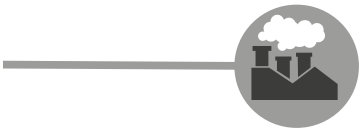
Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Teil 2 – staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 - THG-Emissionsintensität
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („**NACE**“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NYKREDIT REALKREDIT A/S RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,5 %	Dänemark
PORTUGAL (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,0 %	Portugal
BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,0 %	Polen
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,6 %	Italien
NYKREDIT REALKREDIT A/S RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,5 %	Dänemark
EUROPEAN UNION RegS	U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,5 %	Supranational
POLAND (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,5 %	Polen
SPAIN (KINGDOM OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,4 %	Spanien
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,3 %	Italien
ITALY (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,3 %	Italien
ITALY REPUBLIC OF	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,3 %	Italien

CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,2 %	Kanada
CROATIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	Kroatien
KFW MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,2 %	Deutschland
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,2 %	Australien

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

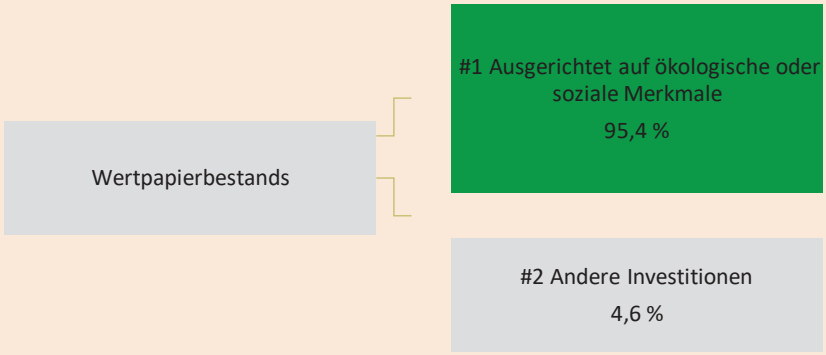
Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 95,4 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,6 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,2 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,7 %
D – Energieversorgung	4,1 %
E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,9 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,4 %
H - Verkehr und Lagerei	0,5 %
J – Information und Kommunikation	2,6 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	38,2 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	5,9 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,1 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,4 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	37,0 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,8 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	4,9 %
Keine	0,3 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

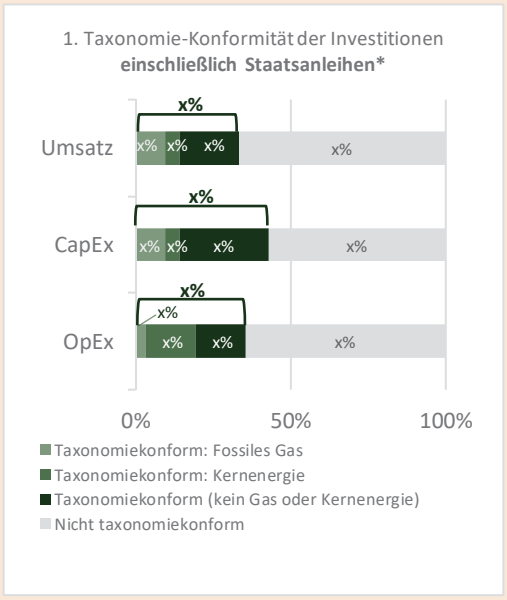
☒ Nein

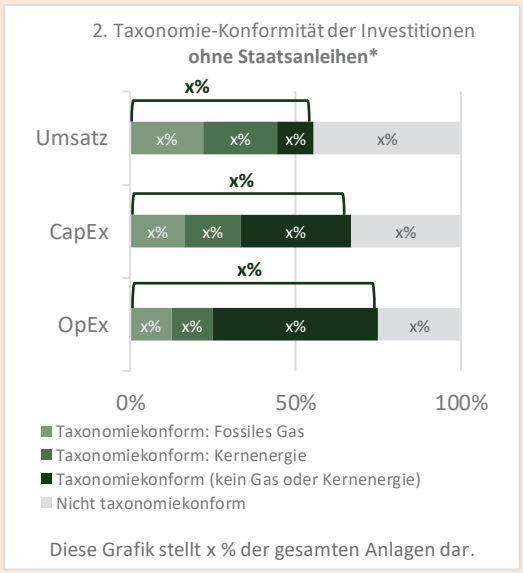
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternenen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten.

Name des Produkts: Neuberger Berman European High Yield Bond Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300Z7RL5FC5H5DB41

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks*, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existierte kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, eine konstruktive Zusammenarbeit mit den Unternehmensemittenten zu priorisieren.
   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	60	1-100	99 %
Daten von Dritten	6,1	0-10	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 10,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 36 %, die auf Basis des Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden ermittelt wurde.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßen haben oder nicht mit diesen vereinbar waren. Seit dem 2. August 2023 wendet das Portfolio die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy an. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze“**), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	59	5,5	98 %
Bezugszeitraum 2023	60	6,1	99 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-8,7 %	34 %
Bezugszeitraum 2023	-10,1 %	36 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k.A.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**"):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
LORCA TELECOM BONDCO SAU RegS	J – Information und Kommunikation	1,5 %	Spanien
EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA MTN RegS	D – Energieversorgung	1,3 %	Portugal
CELLNEX TELECOM SA MTN RegS	J – Information und Kommunikation	1,2 %	Spanien
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS FINANCE B RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	Spanien
DOUGLAS GMBH RegS	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,1 %	Deutschland
BELLIS ACQUISITION COMPANY PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	Großbritannien
VALEO SE MTN RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,0 %	Frankreich
TELECOM ITALIA SPA MTN RegS	J – Information und Kommunikation	1,0 %	Italien
TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT 675 RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	Deutschland
BAYER AKTIENGESELLSCHAFT RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,9 %	Deutschland
NGG FINANCE PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	Großbritannien
CECONOMY AG RegS	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,9 %	Deutschland
IHO VERWALTUNGS GMBH RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,8 %	Deutschland
NIDDA HEALTHCARE HOLDING GMBH RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,8 %	Deutschland
VERISURE HOLDING AB RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,8 %	Schweden

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

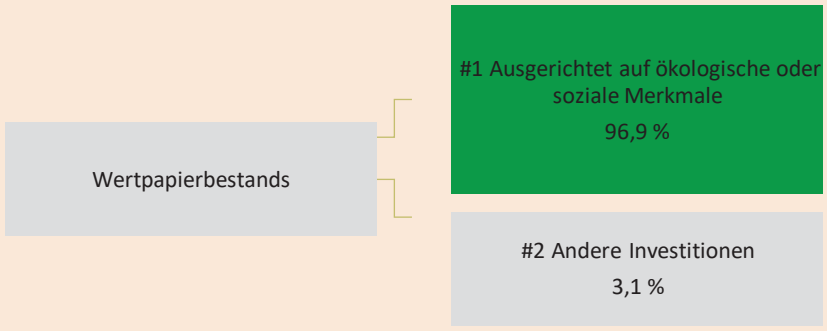
Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögens-werten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	25,2 %
D – Energieversorgung	1,4 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,4 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	5,9 %
H - Verkehr und Lagerei	3,5 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,8 %
J – Information und Kommunikation	17,0 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	35,8 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,9 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	0,7 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	4,7 %
P – Erziehung und Unterricht	0,7 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,9 %
Keine	0,3 %

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Nicht zutreffend – Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

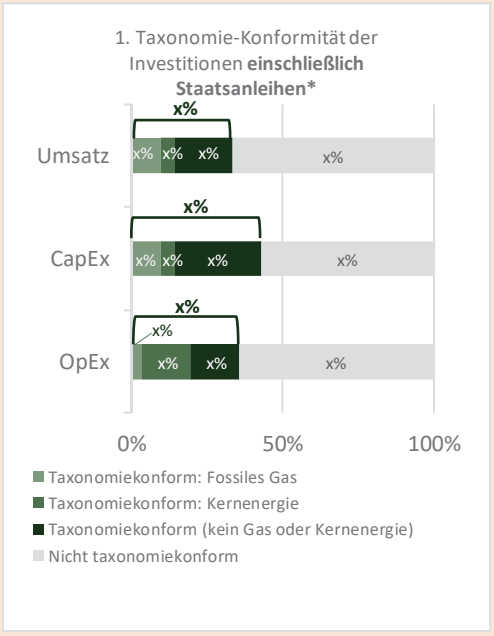
☒ Nein

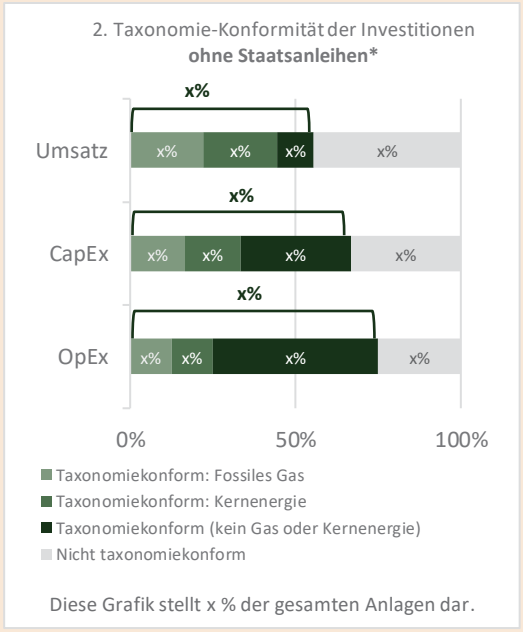
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman European Sustainable Equity Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300K7Y3HBTEX71857

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ Ja	☒ Nein
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 59.9 %* an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

  In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewirbt der Manager die Verringerung des CO2-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.[1]. Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit

[1]Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 3,0	ES: A-D G: 1-4	99 %
Daten von Dritten	7,9	0-10	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,7 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 99 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Das Portfolio hat nicht in Unternehmen investiert, die mehr als 5% ihrer Umsätze über Hersteller von Pelz, Spezialleder oder militärische Auftragnehmer erzielten. Darüber hinaus schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die an umstrittenen Tätigkeiten und Verhaltensweisen beteiligt waren, darunter Glücksspiele, Alkohol und Kernenergie. Ferner schloss das Portfolio Unternehmen aus, die in diktatorische Regime/große ESG-Kontroversen verwickelt waren, Unternehmen, die ein sehr schlechtes Verhalten in Bezug auf Umweltverschmutzung, Menschenrechtsfragen oder Governance-Kontroversen an den Tag legten, und Unternehmen, die in Bezug auf ESG nicht transparent waren oder bei ESG-Kennzahlen insgesamt sehr schlecht abschneiden.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	ES: B G: 2,5	7,9	100 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B G: 3,0	7,9	99 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich das G-Rating des NB-ESG-Quotienten aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter blieb im Vergleich zum Vorjahr unverändert.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-6,2 %	99 %
Bezugszeitraum 2023	-5,7 %	99 %

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

  Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt,

(ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Manager wendete seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle

Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager bei der Feststellung, ob die durch das Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („**NACE**“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ASML HOLDING NV	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,7 %	Niederlande
NESTLE SA	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,5 %	Schweiz
3I GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	5,2 %	Großbritannien
SCHNEIDER ELECTRIC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,6 %	USA
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	4,4 %	Großbritannien
PARTNERS GROUP HOLDING AG	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	4,2 %	Schweiz
EURONEXT NV	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	4,0 %	Niederlande
ASSA ABLOY CLASS B	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,8 %	Schweden
LOREAL SA	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,7 %	Frankreich
STRAUMANN HOLDING AG	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,7 %	Schweiz
KERING SA	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,6 %	Frankreich
ATLAS COPCO CLASS A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,6 %	Schweden
BAKKAFROST	A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei	3,3 %	Faröer Inseln
ADYEN NV	J – Information und Kommunikation	3,2 %	Niederlande
SCOUT24 N	J – Information und Kommunikation	3,0 %	Deutschland

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

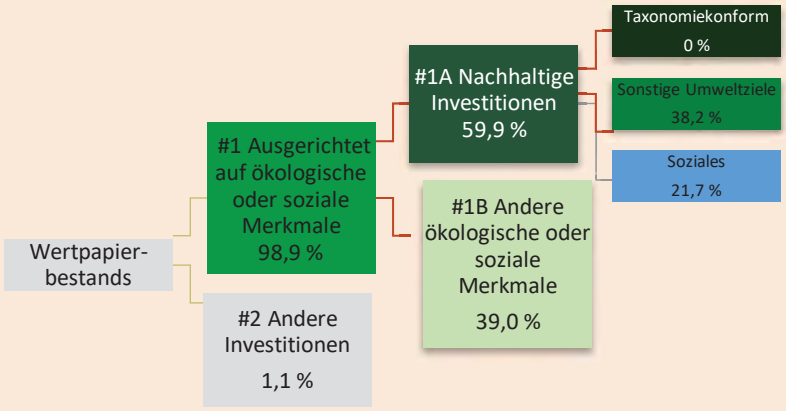
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 98,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 50 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 59,9 % an nachhaltigen Investitionen.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 1,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei	3,3 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	51,0 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	7,7 %
J – Information und Kommunikation	13,4 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	18,2 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	2,5 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,9 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[2]?

☐ Ja:

☐ In fossiles ☐ Gas ☐ In Kernenergie

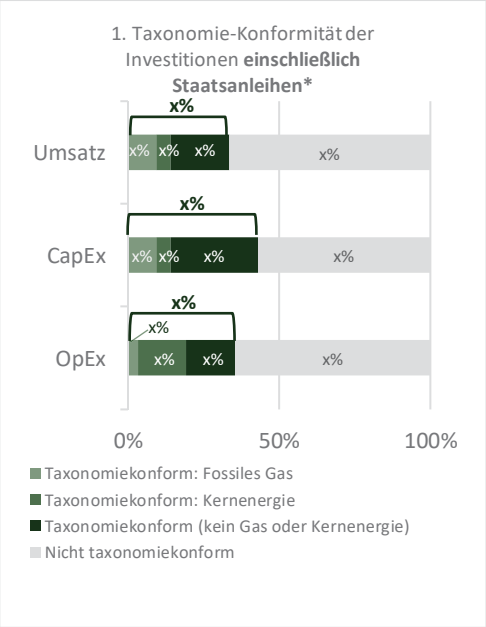
☒ Nein

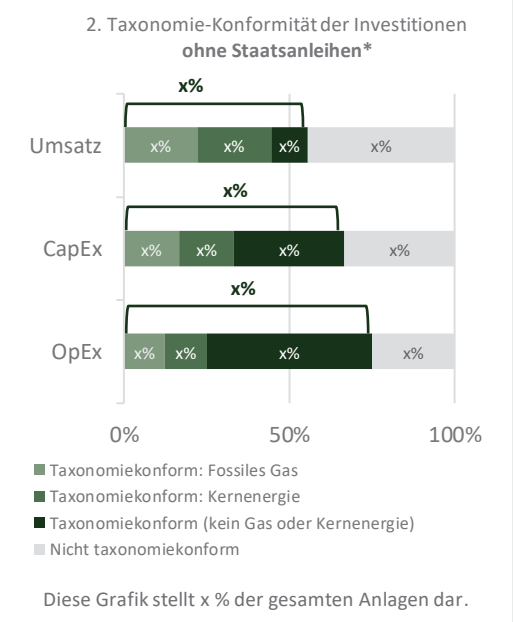
[2] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 38,2 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 21,7 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

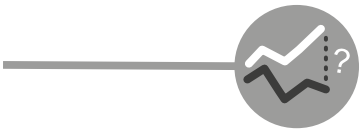
II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Unternehmen über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Bond Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300RDJHEJZZ6XVX05

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie here.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager und Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	66	1-100	67 %
Daten von Dritten	6,6	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 1,6 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers und des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager und der Sub-Investment-Manager der Teilstrategie über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 19 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagten der Manager und der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	68	6,5	77 %
Bezugszeitraum 2023	66	6,6	67 %

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das externe Rating verschlechtert. Die ESG-Analyse wird intern durchgeführt, mit Unterstützung durch die Daten externer Anbieter, und nicht ausgelagert. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nehmen auf kontinuierlicher Basis Bewertungen dieser ESG-Merkmale vor. Von Zeit zu Zeit kann es vorkommen, dass einem Emittent zum Zeitpunkt der Anlage für einen kurzen Zeitraum kein NB-ESG-Quotient-Rating zugewiesen wird Der Manager und der Sub-Investment-Manager stehen in regelmäßigen Abständen mit externen Anbietern von ESG-Daten in Kontakt, um Themen wie die Datenabdeckung zu diskutieren und Optionen zur Behebung von Datenlücken zu prüfen. Die Nutzung mehrerer externer Anbieter von ESG-Daten ermöglicht es dem Manager und dem Sub-Investment-Manager, die Datenabdeckung und die Qualität der Daten der externen Anbieter von ESG-Daten zu bewerten. Darüber hinaus prüfen der Manager und der Sub-Investment-Manager weiterhin neue ESG-Datenprodukte und externe Anbieter von ESG-Daten, um potenzielle Verbesserungen unserer bestehenden ESG-Datenabdeckung zu bewerten.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-1,7 %	24 %
Bezugszeitraum 2023	-1,6 %	19 %

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Abdeckung aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, und der Manager und der Sub-Investment-Manager waren nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
Teil 2 – staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 - THG-Emissionsintensität
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;

- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
CANADA (GOVERNMENT OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	2,27 %	Kanada
KOREA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,81 %	Repbulik Korea
JAPAN (GOVERNMENT OF) 5YR #149	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,75 %	Japan
HESSE (STATE OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,51 %	Deutschland
INDONESIA GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,26 %	Indonesien
KOREA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	1,07 %	Repbulik Korea
GEMEINSAME BUNDESLAENDER RegS	k.A.	1,06 %	Deutschland
CROATIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,99 %	Kroatien
NYKREDIT REALKREDIT A/S RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,96 %	Dänemark
INDONESIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,90 %	Indonesien
UK I/L GILT RegS	k.A.	0,86 %	Großbritannien
JAPAN (GOVERNMENT OF) 30YR #61	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,85 %	Japan
JAPAN (GOVERNMENT OF) 20YR #178	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,85 %	Japan
MADRID COMMUNITY OF RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,84 %	Spanien
FNMA 30YR UMBS	k.A.	0,82 %	k.A.

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

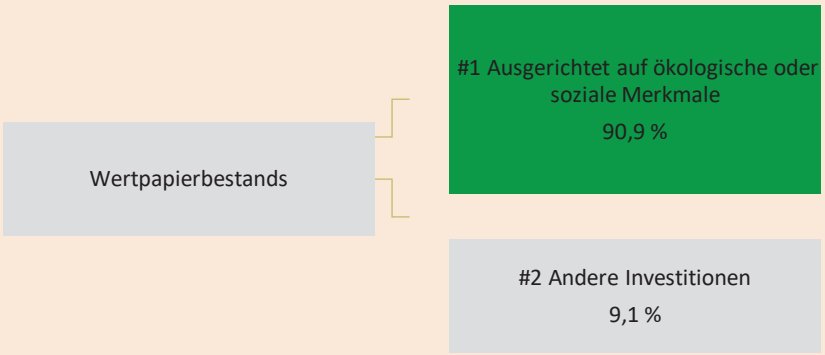
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 60 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 90,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 40 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 9,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer

Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,7 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,4 %
D – Energieversorgung	1,9 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,0 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,5 %
H - Verkehr und Lagerei	0,3 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,2 %
J – Information und Kommunikation	3,7 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	15,1 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,8 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,4 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,1 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	39,2 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	2,7 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,2 %
Keine	28,8 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

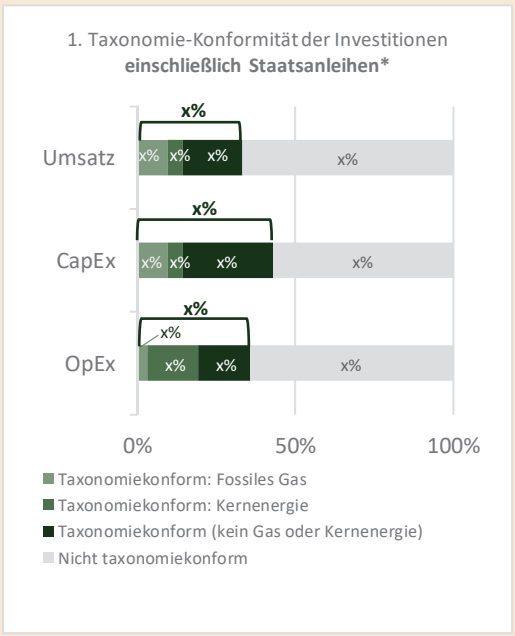
☒ Nein

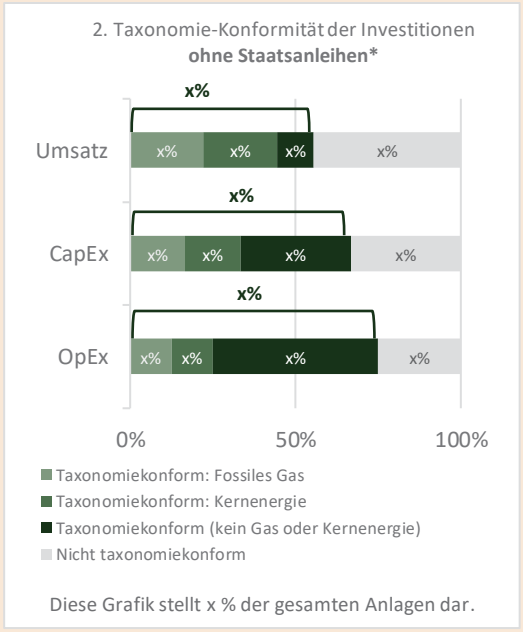
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate, Wertpapiere der Kategorie „To be Announced" [„**TBA**"] oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternenen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

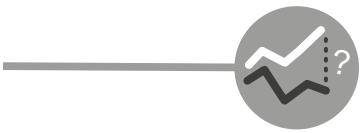
II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen

Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Diversified Income FMP – 2024 (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300577U1V3H24JG33

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Angesichts des Anlageziels, der Anlagedauer und des Fälligkeitsdatums am 30. Juni 2024 (das „**Fälligkeitsdatum**“) war der Portfolioumschlag begrenzt. Obwohl das Portfolio während seiner gesamten Lebensdauer ökologische und soziale Merkmale bewerben wird, konzentrierte sich die Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale auf die Aufbauphase des Portfolios.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	58	1-100	
Daten von Dritten	5,2	0-10	99 %

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Wertverlust von 6,8 % führen könnte. Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige

Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 68 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

Da das Portfolio darauf abzielte, eine Rendite über eine bestimmte Laufzeit zu erzielen, die am Fälligkeitsdatum endet, war der Portfolioumschlag begrenzt.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0 %-100 %
Bezugszeitraum 2022	57	4,9	98 %
Bezugszeitraum 2023	58	5,2	99 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-3,6 %	72 %
Bezugszeitraum 2023	-6,8 %	68 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**"):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem über die vier Kalenderquartalsenden des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitt basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NATWEST GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,89 %	Großbritannien
GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,86 %	USA
SPRINT CORP	J – Information und Kommunikation	2,58 %	USA
BALL CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,54 %	USA
HSBC HOLDINGS PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,52 %	Großbritannien
ATHENE GLOBAL FUNDING 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,51 %	USA
WARNERMEDIA HOLDINGS INC	J – Information und Kommunikation	2,51 %	USA
BARCLAYS PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,48 %	Großbritannien
NRG ENERGY INC 144A	D – Energieversorgung	2,47 %	USA
MAGALLANES INC 144A	J – Information und Kommunikation	2,44 %	USA
MASHREQBANK PSC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,39 %	Vereinigte Arabische Emirate
SYNCHRONY FINANCIAL	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,37 %	USA
EQT MIDSTREAM PARTNERS LP	H - Verkehr und Lagerung	2,29 %	USA
FORD MOTOR CREDIT COMPANY LLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,14 %	USA
BANK MANDIRI (PERSERO) TBK PT MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,13 %	Indonesien

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

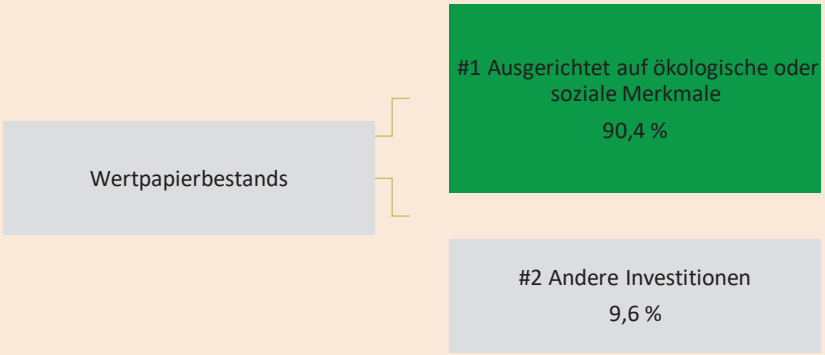
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 90,4 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 9,6 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,7 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,1 %
D – Energieversorgung	4,3 %
H - Verkehr und Lagerei	7,4 %
F – Baugewerbe/Bau	1,0 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	2,0 %
J – Information und Kommunikation	6,8 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	62,8 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,7 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,6 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	6,5 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,8 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,0 %
Keine	2,3 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

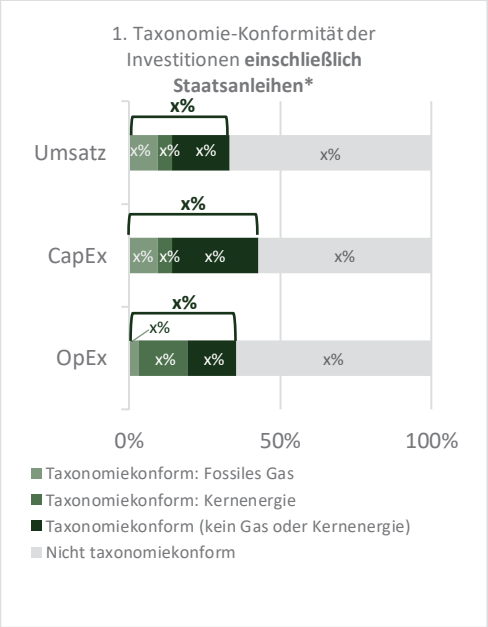
☒ Nein

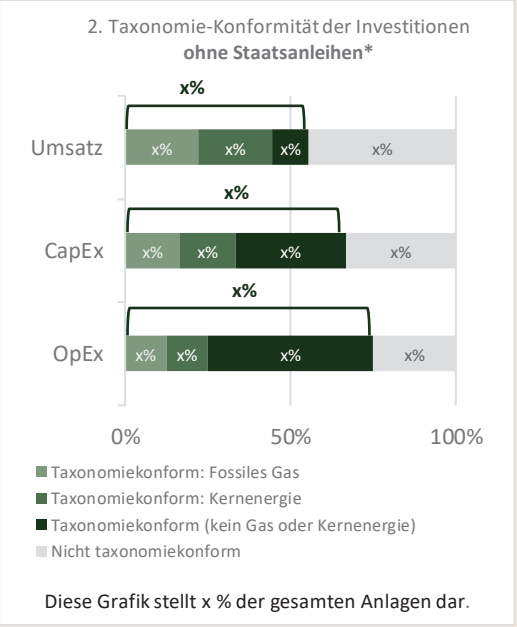
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

In Anbetracht des Anlageziels, der Anlagedauer und des Fälligkeitstermins des Portfolios werden zwar während der gesamten Laufzeit des Portfolios ökologische und soziale Merkmale beworben, doch konzentrierte sich die Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale auf die Aufbauphase des Portfolios, da es die Absicht des Sub-Investment-Manager war, einen geringen Portfolioumschlag zu haben.

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager erachtete diese Zusammenarbeit mit Emittenten als wichtigen Bestandteil seines Anlageprozesses, der es ihm ermöglichte sicherzustellen, dass die erstmalige Beurteilung des Emittenten (bei Auflage) weiterhin zutreffend war und in die laufende Bewertung durch das NB-ESG-Quotient-Rating einfloss. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Equity Megatrends Fund (das „**Portfolio**“)
Unternehmenskennung: 549300NOKC884YXB6S20

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie here.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und werden im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: C G: 2,6	ES: A-D G: 1-4	
Daten von Dritten	5,6	0-10	96 %

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertung der Daten Dritter reichen von 0–10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 34,2 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 92 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	ES: C G: 2,5	5,4	92 %
Bezugszeitraum 2023	ES: C G: 2,6	5,6	96 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verschlechtert und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

2. CVaR

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-27,9 %	94 %
Bezugszeitraum 2023	-34,2 %	92 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhaus-gas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene hing von der Verfügbarkeit angemessener, zuverlässiger und überprüfbarer Daten für diese Indikatoren ab. Stehen solche Daten nicht zur Verfügung, werden die PAIs auf Produktebene erst dann berücksichtigt, wenn diese Daten verfügbar sind. Der Sub-Investment-Manager wird die Liste der von ihm berücksichtigten PAIs auf Produktebene einer aktiven Überprüfung unterziehen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
PETS AT HOME PLC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	5,7 %	Großbritannien
CRITEO ADR REPRESENTING SA	M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	5,7 %	Frankreich
EXPEDIA GROUP INC	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	5,5 %	USA
ALIBABA GROUP HOLDING ADR REPRESEN	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	5,4 %	China
ALPHABET INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	5,0 %	USA
DELTA AIR LINES INC	H - Verkehr und Lagerei	4,9 %	USA
PERRIGO PLC	S – Sonstige Dienstleistungen	4,7 %	USA
STERICYCLE INC	E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	4,6 %	USA
AMDOCS LTD	J – Information und Kommunikation	4,6 %	USA
VISTRA CORP	D – Energieversorgung	4,6 %	USA
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	4,5 %	Kanada
GEN DIGITAL INC	J – Information und Kommunikation	4,5 %	USA
CORNING INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,3 %	USA
UBER TECHNOLOGIES INC	J – Information und Kommunikation	4,2 %	USA
SCHOLASTIC CORP	J – Information und Kommunikation	4,1 %	USA

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

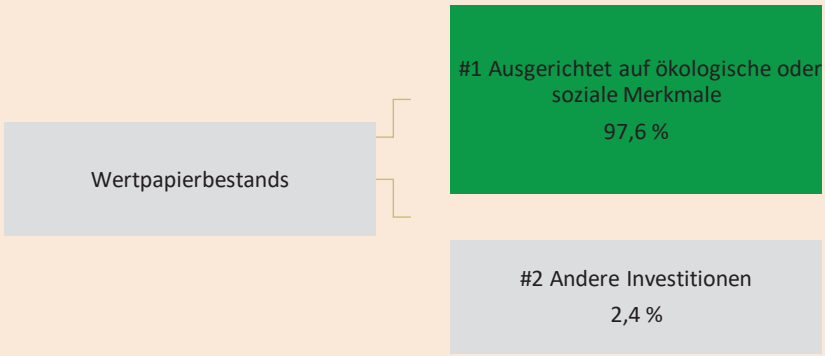
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,6 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,4 % an „sonstigen Investitionen“.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.
#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	13,7 %
D – Energieversorgung	4,7 %
E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	4,8 %
F – Baugewerbe/Bau	1,3 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	11,3 %
H - Verkehr und Lagerei	5,0 %
J – Information und Kommunikation	26,9 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	6,5 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	7,2 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	9,7 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	4,2 %
S – Sonstige Dienstleistungen	4,8 %

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

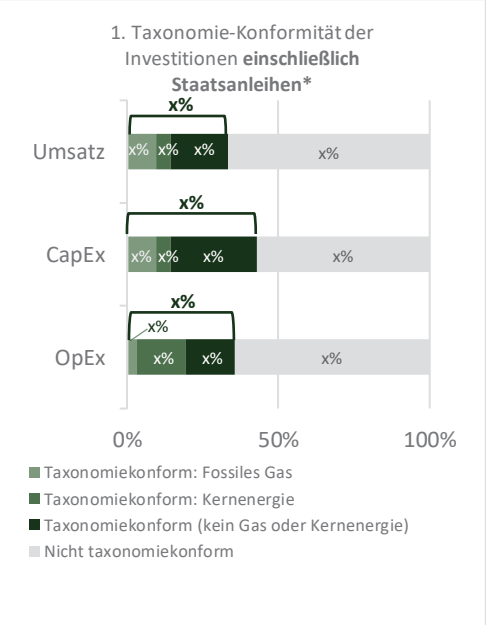
☐ Ja:

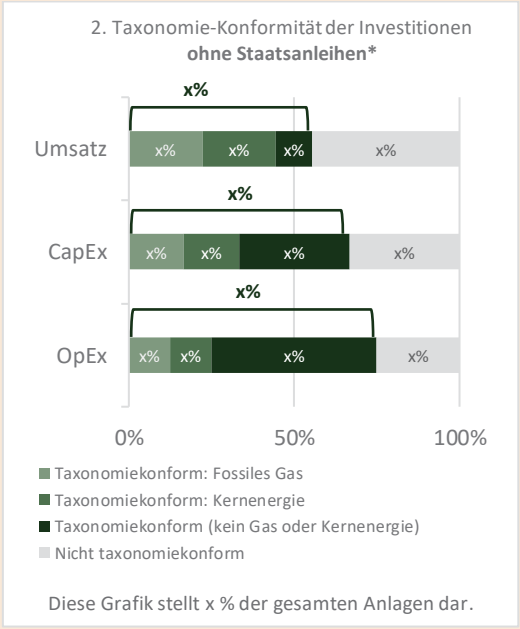
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





* *Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.
Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu

erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass sich der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen konzentrierte, die globalen langfristigen Themen ausgesetzt sind.

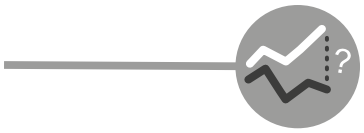
Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Flexible Credit Income Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 5493004BPE0UFYX6FZ81

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	63	1-100	93 %
Daten von Dritten	5,5	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 12,3 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 42 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	62	5,1	93 %
Bezugszeitraum 2023	63	5,5	93 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-12,9 %	48 %
Bezugszeitraum 2023	-12,3 %	42 %

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Abdeckung aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MCAFEE PIK PREF EQUITY Prvt	J – Information und Kommunikation	2,4 %	USA
TREASURY NOTE (OTR)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,7 %	USA
TREASURY BOND (OTR)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,6 %	USA
BOEING CO	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,1 %	USA
AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCA	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	Irland
EPR PROPERTIES	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,8 %	USA
BROADCOM INC 144A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,8 %	USA
CDW LLC/CDW FINANCE	J – Information und Kommunikation	0,7 %	USA
ILIAD HOLDINGS SAS RegS	J – Information und Kommunikation	0,7 %	Frankreich

TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT 675 RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	Deutschland
LORCA TELECOM BONDCO SAU RegS	J – Information und Kommunikation	0,6 %	Spanien
GENERAL MOTORS CO	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,6 %	USA
AIR CANADA 2020-2 CLASS A 144A	k.A.	0,6 %	Kanada
PANTHER BF AGGREGATOR 2 LP / PANTH RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,6 %	USA
UNITED AIR 2020-1 A PTT	H - Verkehr und Lagerung	0,6 %	USA

**O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

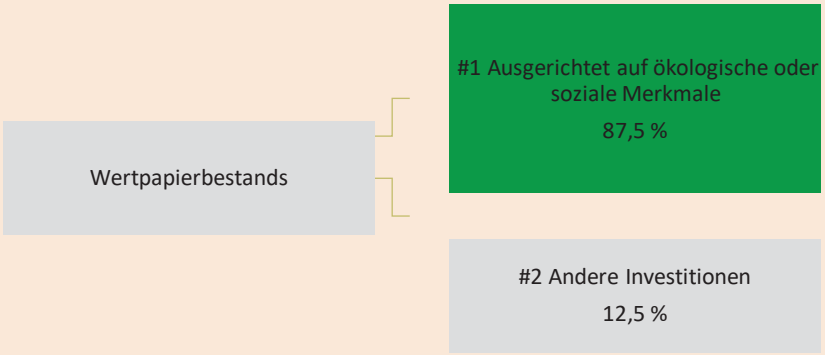
Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 87,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 12,5 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	5,6 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	13,8 %
D – Energieversorgung	2,6 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,4 %
F – Baugewerbe/Bau	0,8 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,9 %
H - Verkehr und Lagerei	5,7 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,4 %
J – Information und Kommunikation	11,7 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	34,0 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,0 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,7 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,2 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	8,0 %
P – Erziehung und Unterricht	0,0 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,3 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	2,0 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,0 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,1 %
Keine	3,7 %

**O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

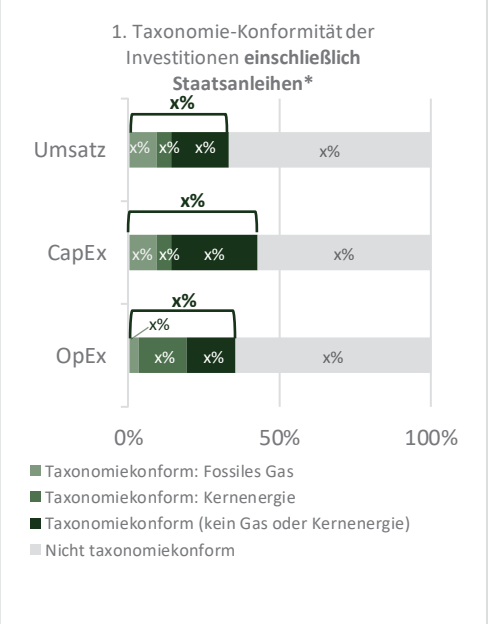
- ☐ Ja:
  - ☐ In fossiles Gas
  - ☐ In Kernenergie
- ☒ Nein

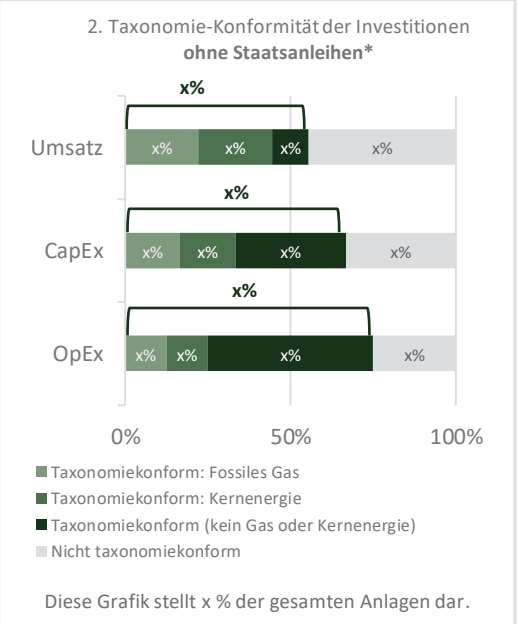
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternenen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

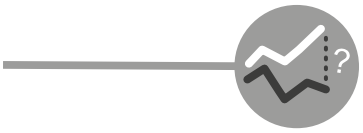
II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – das Portfolio verwendet keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global SDG Engagement Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300YE6BLJU5JCDI13

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 30,1* % an nachhaltigen Investitionen**
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

**Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements bei nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen,

die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Das Portfolio bewarb die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDGs"), indem es sich zum Ziel setzt, mit 100 % der Unternehmensemittenten direkt in Kontakt zu treten (innerhalb von 12 Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere). Der Sub-Investment-Manager hat Leistungskennzahlen („KPIs") für Unternehmensemittenten festgelegt, die auf die SDGs ausgerichtet waren und sich auf die Produkte, Dienstleistungen, betriebliche Tätigkeiten oder Prozesse der Emittenten bezogen, mit dem Ziel, ein positives Ergebnis für die Umwelt und/oder die Gesellschaft zu erzielen. Der Sub-Investment-Manager legte in erster Linie in Emittenten von Unternehmen an, die in der Lage und bereit waren, sich mit ihm über spezifische, auf die SDGs ausgerichtete KPIs auszutauschen.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks*, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde.

Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, einen konstruktiven Dialog mit 100 % der Unternehmensemittenten Vorrang zu priorisieren.

Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	58	1-100	100 %
Daten von Dritten	5,7	0-10	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit:

Wie oben erwähnt, trug der Sub-Investment-Manager zur Erreichung der SDGs bei, indem er sich bemühte, mit 100 % der Unternehmensemittenten in Kontakt zu treten (innerhalb von 12 Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere).

Im Bezugszeitraum wurde mit 100 % der Unternehmensemittenten Kontakt aufgenommen und/oder auf sie eingewirkt, um Treffen zu vereinbaren, doch kam es nur bei 96 % der Unternehmensemittenten zu einem Engagement. Der Sub-Investment-Manager betrachtet diese zusätzliche Zusammenarbeit als mehr als nur eine Interaktion. Weitere Einzelheiten finden Sie in der Neuberger Berman Stewardship and Engagement Policy hier.

Der Sub-Investment-Manager hat nachfolgend eine Zusammenfassung seiner Bemühungen zur Einflussnahme während des Bezugszeitraums beigefügt.

Der Sub-Investment-Manager trat während des Bezugszeitraums mit 296 im Portfolio gehaltenen Unternehmen in Kontakt.
55 % dieser Dialoge des Sub-Investment-Managers waren direkte Einzelgespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch).
51 % der Gespräche des Sub-Investment-Managers fanden mit Mitarbeitern und Mitarbeiterinnen der CEO-/CFO-Ebene statt.

15 der insgesamt 17 UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDG“) wurden vom Sub-Investment-Manager während seiner Zusammenarbeit mit den Unternehmen abgedeckt.
26 % der Unternehmen, mit denen im Bezugszeitraum zusammengearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen.

Weitere Informationen über die Einflussnahme durch den Sub-Investment-Manager finden sich in der Bericht des Portfolios über die Zusammenarbeit hier.

3. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 11,9 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 54 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

4. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der

Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Des Weiteren investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Das Portfolio durfte keine Wertpapiere von Emittenten kaufen, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	68	5,6	100 %
Bezugszeitraum 2023	58	5,7	100 %

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit

	Unternehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde	% der Dialoge waren direkte Einzelge-spräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch)	% der Dialoge erfolgten mit Mitarbeiter/ innen auf CEO/CFO-Ebene	Anzahl der abgedeckten SDGs (von 17)	% der Unternehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen.
Bezugs-zeitraum 2022	207	61 %	50 %	15	20 %
Bezugs-zeitraum 2023	296	55 %	51 %	15	26 %

3. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-9,1 %	53 %
Bezugszeitraum 2023	-11,9 %	54 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

4. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es während des Bezugszeitraums kein nachhaltiges Anlageziel. Seit dem 2. August 2023 hat sich das Portfolio dazu verpflichtet, mindestens 10 % nachhaltige Investitionen zu halten. Die nachhaltigen Investitionen bewarben die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Seit dem 2. August 2023 wendet der Sub-Investment-Manager seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird

	PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser *Abfall*	PAI 8 - Emissionen in Wasser PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;

- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und

- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*" erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**"):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die o. g. PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
LORCA TELECOM BONDCO SAU RegS	J – Information und Kommunikation	0,7 %	Spanien
ASCENT RESOURCES/ARU FIN 144A	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,6 %	USA
GTCR AP FINANCE INC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	USA
AMERICAN AIRLINES INC 144A	H - Verkehr und Lagerung	0,6 %	USA
PRIME SECURITY SERVICES BORROWER L 144A	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,5 %	USA
VERISURE HOLDING AB RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,5 %	Schweden
BLACKSTONE CQP HOLDCO LP 144A	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,5 %	USA
SOLARIS MIDSTREAM HOLDINGS LLC 144A	H - Verkehr und Lagerung	0,5 %	USA
PRESIDIO HOLDING INC 144A	J – Information und Kommunikation	0,5 %	USA
ON ASSIGNMENT INC 144A	J – Information und Kommunikation	0,5 %	USA
NOVELIS SHEET INGOT GMBH RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,5 %	USA
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP 144A	J – Information und Kommunikation	0,4 %	USA
SUMMIT MIDSTREAM HOLDINGS LLC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,4 %	USA
IRON MOUNTAIN INC 144A	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,4 %	USA
MOZART DEBT MERGER SUB INC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,4 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

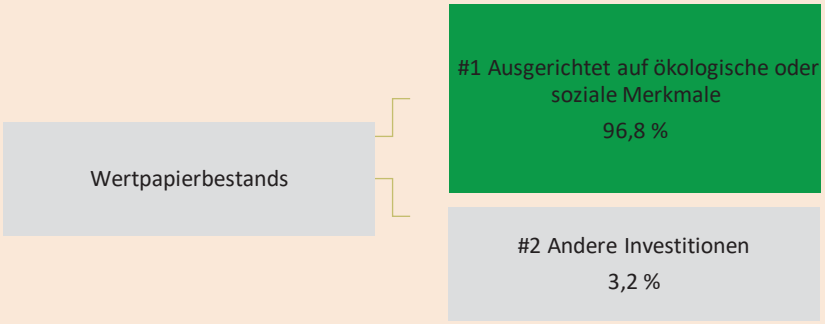
- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,8 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in diesem periodischen Bericht wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände als Durchschnitt zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 30,1 % an nachhaltigen Investitionen.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,2 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten

im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet, mit Ausnahme der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen. In diesem Falle wurden die Daten lediglich für diesen Bezugszeitraum auf Grundlage des Durchschnitts zum Ende des dritten und vierten Quartals berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen als Durchschnitt des dritten und vierten Quartals 2023 beträgt 30,1 %. Darin enthalten sind 19,6 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind, und 10,5 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	5,8 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	17,0 %
D – Energieversorgung	3,4 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,7 %
F – Baugewerbe/Bau	2,0 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	5,4 %
H - Verkehr und Lagerei	7,3 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,2 %
J – Information und Kommunikation	12,9 %

K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	29,3 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,8 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	1,2 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	5,7 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	2,9 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,0 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,1 %
Keine	1,3 %

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

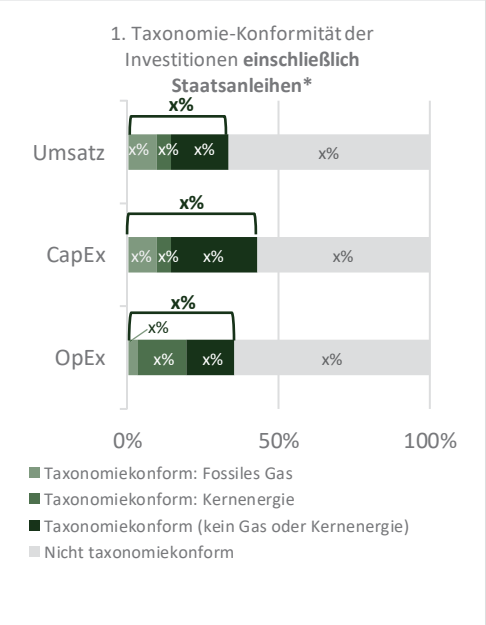
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

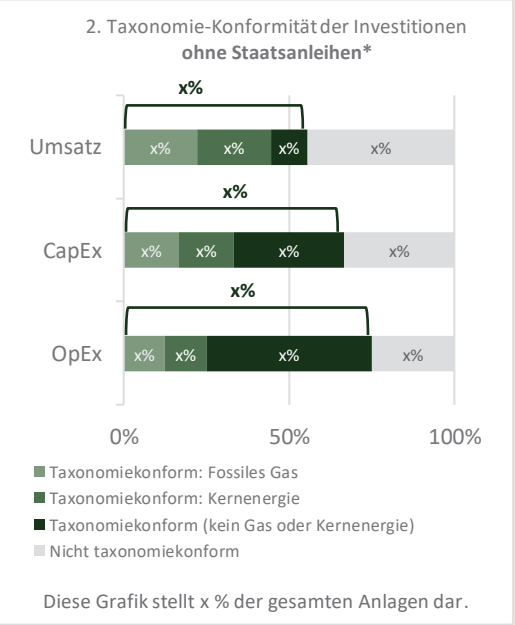
☒ Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 19,6 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 10,5 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben,

verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Dieses Programm konzentrierte sich auf persönliche Treffen und Telefonkonferenzen, um die ESG-Risiken und -Chancen zu verstehen und die gute

Unternehmensführung der Emittenten zu bewerten. Im Rahmen der direkten Zusammenarbeit hat der Sub-Investment-Manager Ziele festgelegt, welche Ziele die Emittenten erreichen sollten. Diese Ziele sowie die Fortschritte der Emittenten im Hinblick auf diese Ziele wurden vom Sub-Investment-Manager mit Hilfe eines internen Systems von NB zur Nachverfolgung der Mitwirkung erfasst und überwacht (weitere Einzelheiten sind dem obigen Abschnitt über die Mitwirkung zu entnehmen).

Das Portfolio bewarb ökologische und soziale Merkmale. Zugleich leistete es einen Beitrag zur Erreichung der SDGs, indem darauf abgezielt wurde, direkt mit allen Unternehmensemittenten (innerhalb von zwölf Monaten nach Kauf der durch den Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere) zusammenzuarbeiten. Die Mitwirkung erfolgte in erster Linie über persönliche Treffen und Gespräche sowie durch Festlegung von wesentlichen Leistungsindikatoren (KPIs), die auf die SDGs ausgerichtet sind und auf die Produkte, Dienstleistungen, den Geschäftsbetrieb oder die Prozesse der Emittenten Bezug nahmen. Damit sollte ein positives Ergebnis bezogen auf die Umwelt und/oder Gesellschaft erzielt werden. Der Sub-Investment-Manager legte in erster Linie in Emittenten von Unternehmen an, die in der Lage und bereit waren, sich mit ihm über spezifische, auf die SDGs ausgerichtete KPIs auszutauschen. Der Sub-Investment-Manager beurteilte vierteljährlich die Fortschritte der im Portfolio vertretenen Emittenten gegenüber den festgelegten KPIs. Diese direkte Mitwirkung bei Unternehmensemittenten war wesentlicher Bestandteil des Anlageprozesses und ausschlaggebend für den Portfoliobeitrag zur Erreichung der SDGs.

Der Sub-Investment-Manager nutzte ein hausinternes Instrument, um im Vorfeld einer Anlage die Wahrscheinlichkeit auf Erfolg bei der Mitwirkung gegenüber einem Emittenten festzustellen (der „**Mitwirkungspotenzial-Indikator**“). Der Mitwirkungspotenzial-Indikator bietet auf einer Skala von 1–5 eine systematische Bewertung der Bereitschaft und Fähigkeit eines Emittenten, mit dem Sub-Investment-Manager zu den SDGs zusammenzuarbeiten. Ein Emittent, der beispielsweise als nicht bereit oder fähig zur Zusammenarbeit eingestuft wurde, erhielt einen Mitwirkungspotenzial-Indikator von „1“, während ein Emittent, der zur Zusammenarbeit bereit war, um ein Vorreiter bei der Unterstützung der SDGs zu werden, mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von „5“ bewertet wurde. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von weniger als „2“. Mit dem Mitwirkungspotenzial-Indikator wurden neben den finanziellen Beschränkungen für den Emittenten verschiedene Faktoren berücksichtigt, darunter die Bedeutung der SDGs im Geschäftsbetrieb des Emittenten, die Offenlegungspraktiken des Emittenten und die Beziehung des Sub-Investment-Managers zum Emittenten.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Investment Grade Credit Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300TIVE0UW3FSBE51

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie here.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten ein, die einen schlechten NB-ESG-Quotienten aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachen) zu erreichen.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	61	1-100	100 %
Daten von Dritten	6,8	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 3,3 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 68 %. Diese Deckung

ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	62	6,7	100 %
Bezugszeitraum 2023	61	6,8	100 %

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-3,4 %	71 %
Bezugszeitraum 2023	-3,3 %	68 %

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**"):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
UNITED AIR 2020-1 A PTT	H - Verkehr und Lagerung	1,5 %	USA
WEC ENERGY GROUP INC	D – Energieversorgung	1,3 %	USA
HSBC HOLDINGS PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,3 %	Großbritannien
ATHENE GLOBAL FUNDING 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	USA
JP MORGAN CHASE & CO	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	USA
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	USA
BARCLAYS PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	Großbritannien
MARATHON PETROLEUM CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,9 %	USA
DELL INTERNATIONAL LLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	USA
SOUTHERN ELECTRIC GENERATING CO	D – Energieversorgung	0,9 %	USA
LLOYDS BANKING GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	Großbritannien
DOMINION ENERGY INC	D – Energieversorgung	0,8 %	USA
CITIGROUP INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	USA
ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	Belgien
F&G GLOBAL FUNDING RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

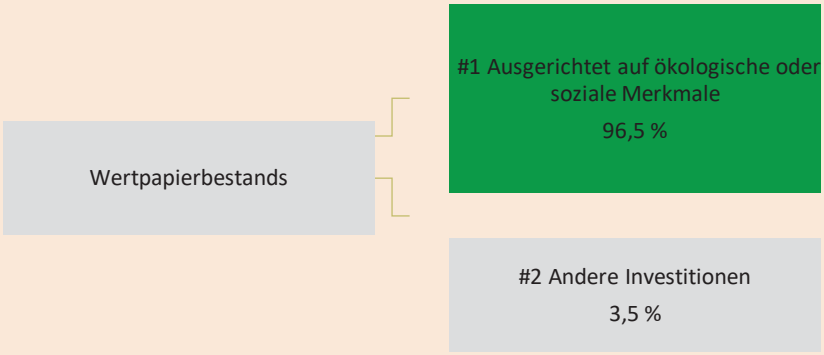
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,5 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,1 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	14,3 %
D – Energieversorgung	9,2 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,7 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,2 %
H - Verkehr und Lagerei	5,2 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,7 %
J – Information und Kommunikation	13,0 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	45,5 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,5 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,9 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,8 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,5 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,8 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,5 %
Keine	0,2 %

**O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

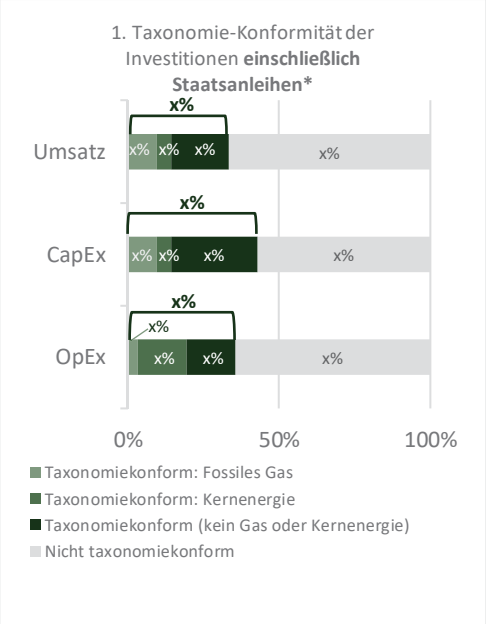
- ☐ Ja:
  - ☐ In fossiles Gas
  - ☐ In Kernenergie
- ☒ Nein

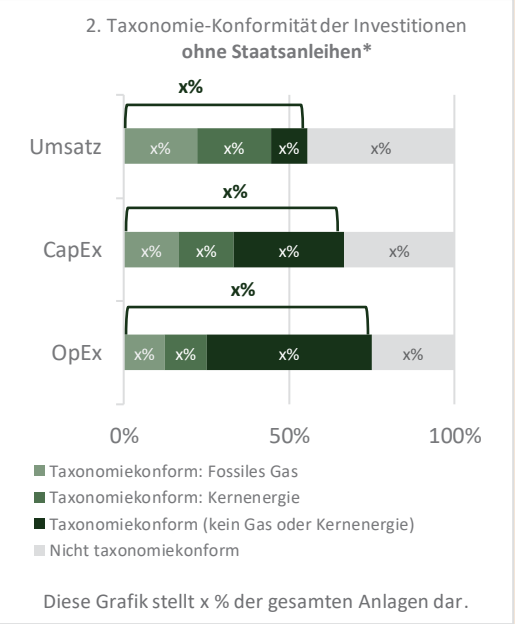
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

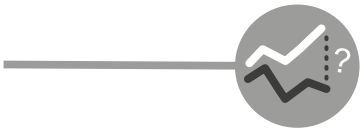
Durch die Integration der hausinternenen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Opportunistic Bond Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300ZNZZ2YDVTNRE14

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager und Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	62	1-100	73 %
Daten von Dritten	6,2	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandels pro Emission und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 4,5 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers und des Sub-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager und der Sub-Investment-Manager der Teilstrategie über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 23 %, was einem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagten der Manager und der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	61	5,7	80 %
Bezugszeitraum 2023	62	6,2	73 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Rating des Emittenten.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung des NB ESG-Quotienten und des externen Ratings aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Emittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verlagert.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-4,2 %	24 %
Bezugszeitraum 2023	-4,5 %	23 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, und der Manager und der Sub-Investment-Manager waren nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatliche PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“):

Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Teil 2 – staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 - THG-Emissionsintensität
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und

Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

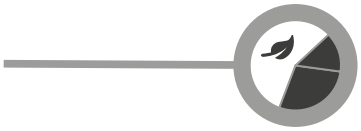
Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NEW ZEALAND (GOVERNMENT OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	4,6 %	Neuseeland
MEX BONOS DE DESARROLLO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,1 %	Mexiko
TREASURY NOTE (2OLD)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	USA
NGG FINANCE PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	Großbritannie
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNM	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,1 %	China
PORTUGAL (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,9 %	Portugal
CHINA PEOPLES REPUBLIC OF (GOVERNM	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,9 %	China
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES) (GO	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,8 %	Mexiko
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,8 %	USA

POLAND (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,8 %	Polen
STACR_18-DNA1 M2	k.A.	0,7 %	USA
FNMA 30YR UMBS	k.A.	0,7 %	k.A.
STACR 2017-DNA1 M2	k.A.	0,7 %	USA
INDONESIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,7 %	Indonesien
ELECTRICITE DE FRANCE SA MTN RegS	D – Energieversorgung	0,7 %	Frankreich

**O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

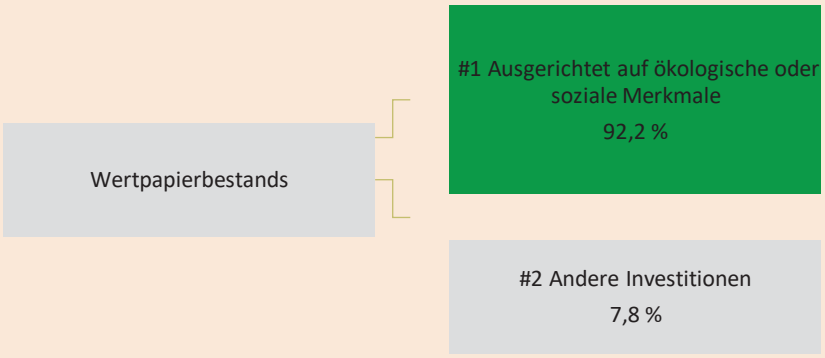
Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 65 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 92,2 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 35 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 7,8 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,7 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	7,6 %
D – Energieversorgung	1,9 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,3 %
F – Baugewerbe/Bau	0,1 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,2 %
H - Verkehr und Lagerei	1,3 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,0 %
J – Information und Kommunikation	5,5 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	18,9 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,6 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,1 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,5 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	30,6 %
P – Erziehung und Unterricht	0,2 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,1 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,7 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,6 %
Keine	26,1 %

**O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

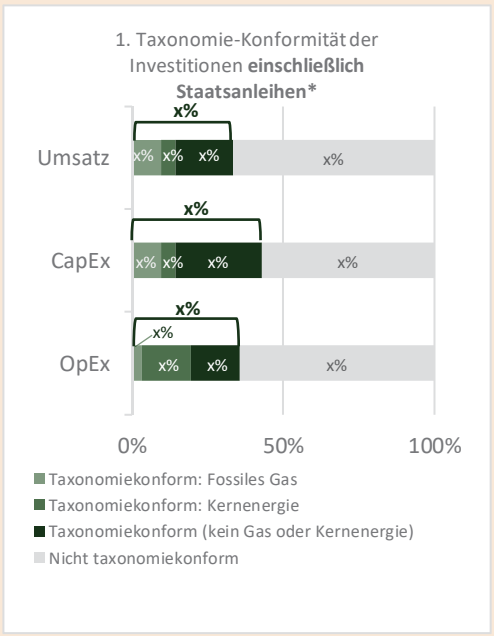
- ☐ Ja:
  - ☐ In fossiles Gas
  - ☐ In Kernenergie
- ☒ Nein

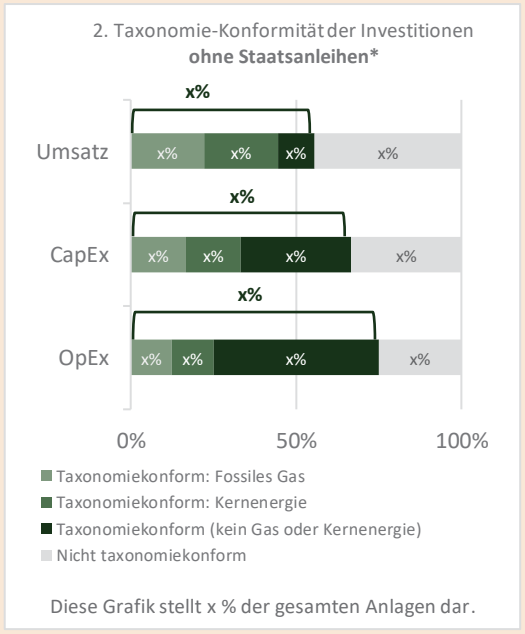
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate, Wertpapiere der Kategorie „To be Announced" [„**TBA**"] oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternenen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

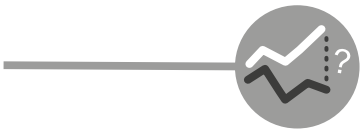
Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen

Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Real Estate Securities Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300JYOIU4VRI67006

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Alle Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**")*, Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, und Materialbeschaffung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette und Vielfalt und Integration der Belegschaft.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet. Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 1,8	ES: A-D G: 1-4	98 %
Daten von Dritten	6,5	0-10	

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 24,6 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 96 %. Diese Deckung

ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Der Sub-Investment-Manager untersagte Investitionen in Emittenten, die private Gefängnisse besitzen, betreiben oder überwiegend wesentliche Dienstleistungen für diese erbringen. Die Gründe sind die erheblichen sozialen Kontroversen, die Reputationsrisiken, die Abhängigkeit von der Politik der Justizministerien und der Umstand, dass diese Einrichtungen nicht ohne weiteres für andere Zwecke umgestaltet werden können.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	ES: B G: 1,7	6,4	100 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B	6,5	98 %

	G: 1,8		

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten ist zurückgegangen. Die Bewertung der Daten Dritter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-15,9 %	94 %
Bezugszeitraum 2023	-24,6 %	96 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich der prognostizierte CVaR-Verlust aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios erhöht. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investit*ionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden*, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**"):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhaus-gas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäfti-gung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
AMERICAN TOWER REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	5,1 %	USA
PROLOGIS REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,7 %	USA
PUBLIC STORAGE REIT	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,5 %	USA
CROWN CASTLE INC	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,2 %	USA
EQUINIX REIT INC	J – Information und Kommunikation	3,0 %	USA
UOL GROUP LTD	F – Baugewerbe/Bau	2,9 %	Singapur
MITSUI FUDOSAN LTD	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,8 %	Japan
REALTY INCOME REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,7 %	USA
WELLTOWER INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,4 %	USA
REGION GROUP STAPLED UNITS LTD	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,4 %	Australien
KIMCO REALTY REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,3 %	USA
SIMON PROPERTY GROUP REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,2 %	USA
VICI PPTYS INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,2 %	USA
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,1 %	Kanada
SEGRO REIT PLC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,1 %	Großbritannien

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

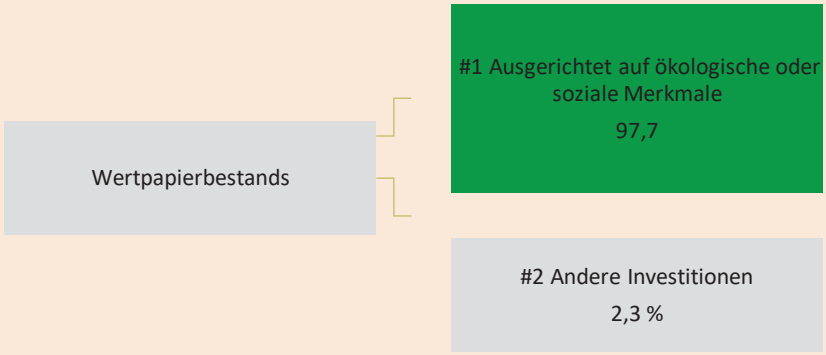
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,7 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,3 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der

Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,6 %
F – Baugewerbe/Bau	7,8 %
H - Verkehr und Lagerei	0,7 %
J – Information und Kommunikation	4,9 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	81,8 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,2 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

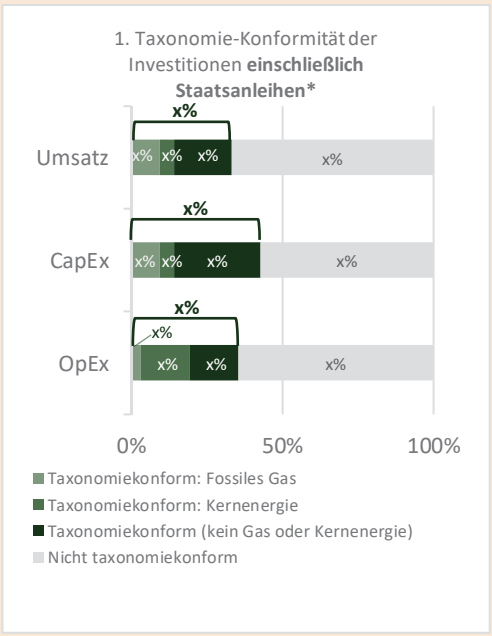
☒ Nein

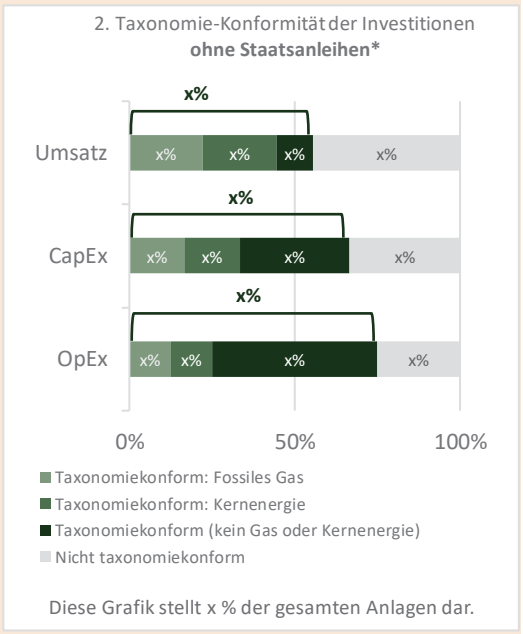
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte. Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine Bewertung bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Sustainable Equity Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300XRT8BVEN8P0A74

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 60.1 %* an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

  In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewirbt der Manager die Verringerung des CO2-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.[1]. Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-

[1]Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,4	ES:A-D G: 1-4	
Daten von Dritten	7,4	0-10	99 %

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,0 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 99 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Das Portfolio hat nicht in Unternehmen investiert, die mehr als 5% ihrer Umsätze über Hersteller von Pelz, Spezialleder oder militärische Auftragnehmer erzielten. Darüber hinaus schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die an umstrittenen Tätigkeiten und Verhaltensweisen beteiligt waren, darunter Glücksspiele, Alkohol und Kernenergie. Ferner schloss das Portfolio Unternehmen aus, die in diktatorische Regime/große ESG-Kontroversen verwickelt waren, Unternehmen, die ein sehr schlechtes Verhalten in Bezug auf Umweltverschmutzung, Menschenrechtsfragen oder Governance-Kontroversen an den Tag legten, und Unternehmen, die in Bezug auf ESG nicht transparent waren oder bei ESG-Kennzahlen insgesamt sehr schlecht abschneiden.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	Rating der Daten durch externe Anbieter	Kombinierte Abdeckung
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	ES: B G: 2,2	7,2	100 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B G: 2,4	7,4	99 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verschlechtert und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

2. CVaR

	CVaR	Abdeckung
Bezugszeitraum 2022	-5 %	99 %
Bezugszeitraum 2023	-5 %	99 %

Die CVaR-Prognose ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Manager wendete seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle

Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager bei der Feststellung, ob die durch das Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind

Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („**NACE**“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J – Information und Kommunikation	8,3 %	USA
ALPHABET INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	5,8 %	USA
AMAZON COM INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	5,1 %	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,9 %	USA
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,3 %	USA
NETFLIX INC	J – Information und Kommunikation	3,0 %	USA
3I GROUP PLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,9 %	Großbritannien
NIKE INC CLASS B	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,8 %	USA
BAKKAFROST	A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei	2,7 %	Faröer Inseln
ADOBE INC	J – Information und Kommunikation	2,6 %	USA
INTUIT INC	J – Information und Kommunikation	2,6 %	USA
ASML HOLDING NV	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	Niederlande

ESTEE LAUDER INC CLASS A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	USA
ADYEN NV	J – Information und Kommunikation	2,3 %	Niederlande
S&P GLOBAL INC	J – Information und Kommunikation	2,3 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

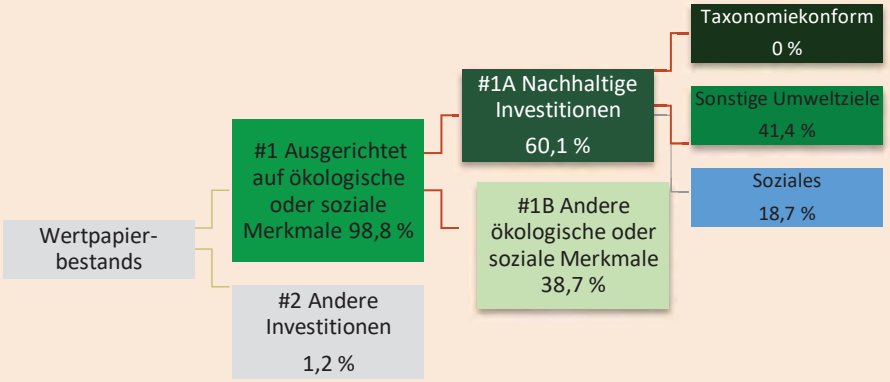
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 98,8 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 50 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 60,1 % an nachhaltigen Investitionen.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 1,2 % „Andere Investitionen“.

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei	2,8 %
C – Fertigung	32,6 %
G – Handel, Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	8,9 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,6 %
J – Information und Kommunikation	30,9 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	19,2 %
N – Verwaltungs- und Unterstützungsdienstleistungen	5,0 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[2]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

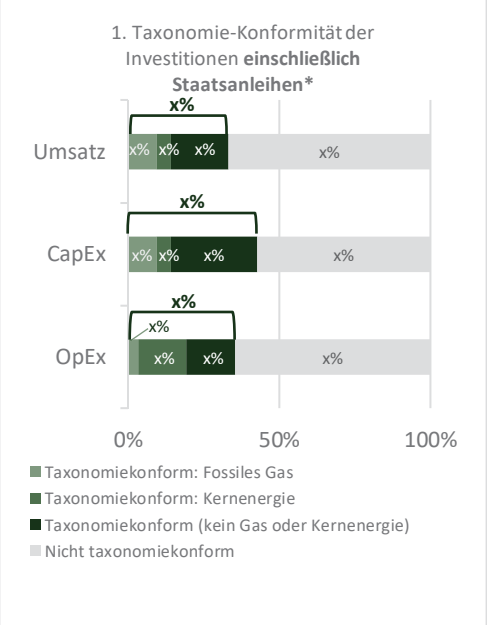
☒ Nein

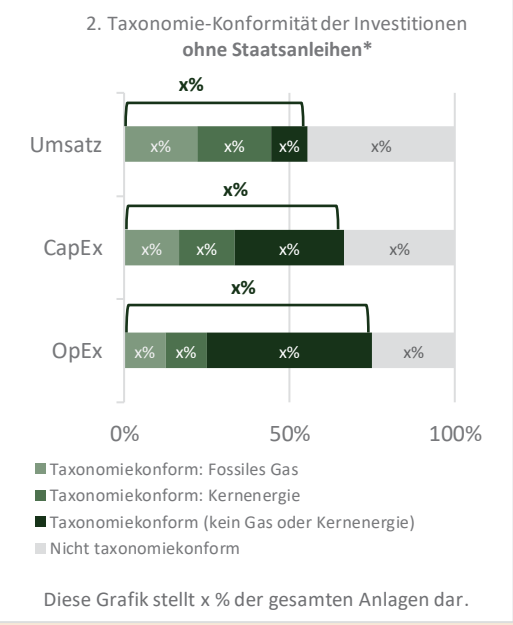
[2] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 41,4 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 18,7 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

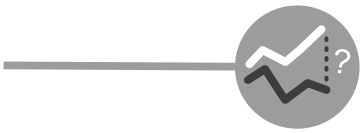
Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Unternehmen über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund (das „**Portfolio**“)*

Unternehmenskennung: 549300VLTCS1K4EA7H66

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 66,9 %* an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Mit Wirkung vom 2. August 2023 änderte der Neuberger Berman Systematic Global Sustainable Value Fund seinen Namen in Neuberger Berman Global Sustainable Value Fund.

**Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

  In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarb und bewirbt der Sub-Investment-Manager künftig die Verringerung des CO2-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.[1] Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem Composite-ESG-Rating gemessen und wird im Folgenden in aggregierter Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

I. Das Composite-ESG-Rating:

Die vorstehend aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale wurden anhand einer Mischung aus ökologischen und sozialen Merkmalen abgeleitet und beurteilt, die aus dem hausinternen Neuberger Berman ESG-Ratingsystem (der „**NB-ESG-Quotient**") und einem themenbasierten ESG-Ratingsystem („**NB-ESG-Themen**"), (zusammen das „**Composite-ESG-Rating**") stammen.

Der NB- ESG-Quotient basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und ergab ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem er diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet. Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

[1] Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Das Ratingsystem in Bezug auf NB-ESG-Themen basiert auf dem Konzept sektorspezifischer ESG-Themen (bereitgestellt von Drittanbietern), die individuell gewichtet wurden und ein unternehmensspezifisches Gesamtrating in Bezug auf NB-ESG-Themen ergaben. Die sektorspezifischen NB-ESG-Themen erstreckten sich auf einzelne wesentliche ESG-Belange bzw. -Merkmale oder aggregierten wesentliche ESG-Belange bzw. -Merkmale, die ihrerseits ein ESG-Thema bilden. Die betreffenden ökologischen und sozialen Merkmale sind vorstehend aufgeführt und Teil der übergeordneten ESG-Themen.

Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden Composite-ESG-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten Composite-ESG-Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Das Composite-ESG-Rating von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein Composite-ESG-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
Composite-ESG-Rating	0,6	-1 bis +1	100 %
Daten von Dritten	7,3	0-10	

Für das Composite-ESG-Rating wird ein Wert zwischen -1 und +1 verwendet, wobei -1 das niedrigste und +1 das höchste Rating darstellt.

Das durchschnittliche Composite-ESG-Rating ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

II. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und, bis zum 2. August 2023, die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusions Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Zur Klarstellung sei angemerkt, dass die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusions Policy ab dem 2. August 2023 nicht mehr angewandt wurde. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem Composite-ESG-Rating und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Composite-ESG-Rating

	Composite-ESG-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	-1 bis +1	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	0,6	7,3	100 %
Bezugszeitraum 2023	0,6	7,3	100 %

Das Composite-ESG-Rating und die Bewertung der Daten Dritter sind im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie

nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhaus-gas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäfti-gung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche

Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*" erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
APPLE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,1 %	USA
ALPHABET INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	1,7 %	USA
COMCAST CORP	J – Information und Kommunikation	1,6 %	USA
MERCK & CO INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,5 %	USA
SHELL PLC	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,5 %	Großbritannien
TOTALENERGIES	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,4 %	Frankreich
GILEAD SCIENCES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,3 %	USA
ABBVIE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,2 %	USA
MICROSOFT CORP	J – Information und Kommunikation	1,2 %	USA
CISCO SYSTEMS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,2 %	USA
AMERIPRISE FINANCE INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,1 %	USA
CIGNA	Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,1 %	USA
CITIGROUP INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	USA
APPLIED MATERIAL INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,0 %	USA
CSX CORP	H - Verkehr und Lagerung	1,0 %	USA

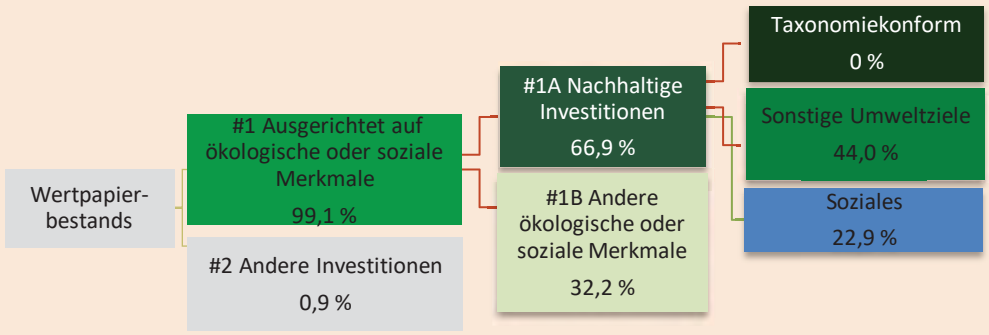
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 99,1 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 50 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 66,9 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 0,9 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein ESG-Composite-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte, und seine Berechnungen können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Dritten basieren. Die Berechnung beruhte auf einer Marktbewertung des Portfolios. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:
- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	4,4 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	38,8 %
D – Energieversorgung	1,6 %
F – Baugewerbe/Bau	2,9 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	7,5 %
H - Verkehr und Lagerei	4,0 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,6 %

J – Information und Kommunikation	12,7 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	20,7 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,9 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,8 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,8 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	2,0 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,1 %
Keine	0,1 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, ob das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[2]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

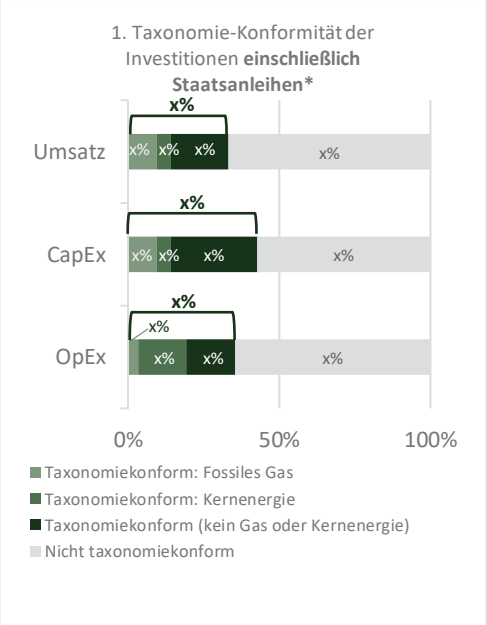
☒ Nein

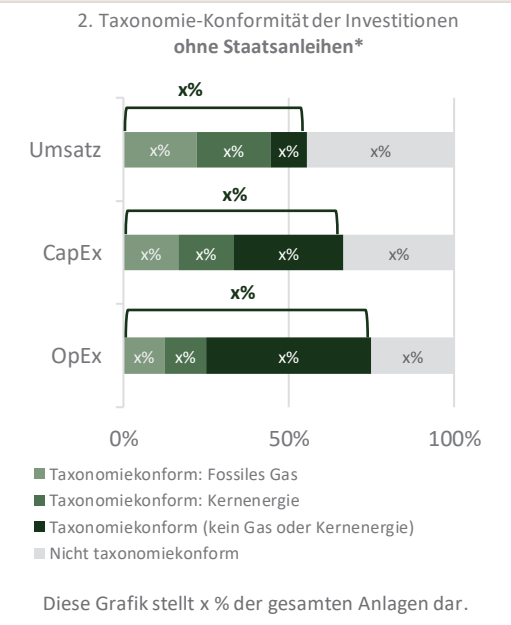
[2] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 44,0 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 22,9 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) das Composite-ESG-Rating sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

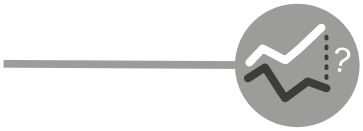
Das ESG-Composite-Rating (wie vorstehend erläutert) wurde verwendet, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu messen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (das ESG-Composite-Rating) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager nutzte die von NB intern geführten Dialoge mit den Managementteams der Unternehmen. Dies wurde durch ein robustes ESG-Dialogprogramm erreicht, das auf Ebene der NB-Einheiten und nicht auf Portfolioebene stattfand. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen intern geführten Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman High Yield Bond Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300IJY8N43QRUU802

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine achhaltigen Investitionen angestrebt wurden enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks*, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.
- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Des Weiteren war der Sub-Investment-Manager bestrebt, eine konstruktive Zusammenarbeit mit den Unternehmensemittenten zu priorisieren.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	57	1-100	99 %
Daten von Dritten	5,3	0-10	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 12,3 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten

beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 51 %, was aus dem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet wurde.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	57	5,0	99 %
Bezugszeitraum 2023	57	5,3	99 %

Im Vergleich zum Vorjahr ist die Bewertung des NB-ESG-Quotienten unverändert geblieben und die Bewertung der Daten Dritter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. CVaR

	CVaR	Abdeckung
Bezugszeitraum 2022	-12,0 %	57 %
Bezugszeitraum 2023	-12,3 %	51 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Abdeckung aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmensemittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k.A.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**"):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NEW FORTRESS ENERGY INC 144A	D – Energieversorgung	0,9 %	USA
AMERICAN AIRLINES INC 144A	H - Verkehr und Lagerung	0,9 %	USA
AMERICAN AIRLINES INC 144A	H - Verkehr und Lagerung	0,8 %	USA
TREASURY NOTE (OLD)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,7 %	USA
PAREXEL 2L TL-B 7/21 Prvt	Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,6 %	USA
ALLIANT HOLDINGS INTERMEDIATE LLC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	USA
TRANSDIGM INC 144A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,6 %	USA
CCO HOLDINGS LLC 144A	J – Information und Kommunikation	0,6 %	USA
BLACKSTONE CQP HOLDCO LP 144A	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,6 %	USA
PRESIDIO HOLDING INC 144A	J – Information und Kommunikation	0,6 %	USA
CSC HOLDINGS LLC 144A	J – Information und Kommunikation	0,5 %	USA
CHART INDUSTRIES INC 144A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,5 %	USA
SUMMIT MIDSTREAM HOLDINGS LLC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,5 %	USA
GLOBAL INFRASTRUCTURE SOLUTIONS IN 144A	F – Baugewerbe/Bau	0,5 %	USA
CARNIVAL HOLDINGS (BERMUDA) LTD 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,5 %	Bermuda

O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

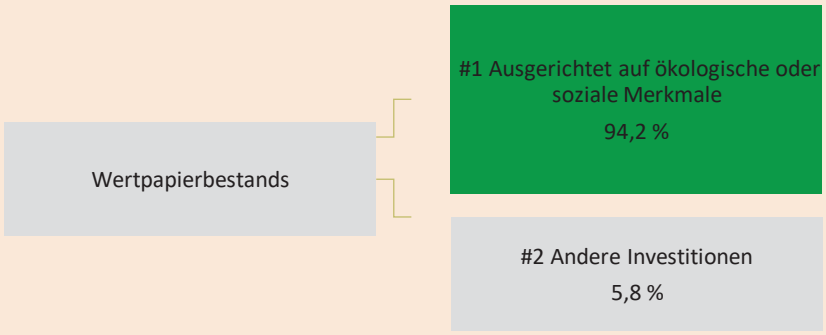
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 94,2 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 5,8 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	8,1 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	15,6 %
D – Energieversorgung	4,9 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,1 %
F – Baugewerbe/Bau	1,6 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	5,1 %
H - Verkehr und Lagerei	10,9 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,5 %
J – Information und Kommunikation	12,8 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	19,4 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,9 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,6 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	7,0 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung	0,7 %
P – Erziehung und Unterricht	0,0 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	3,6 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	2,3 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,3 %
Keine	2,5 %

O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

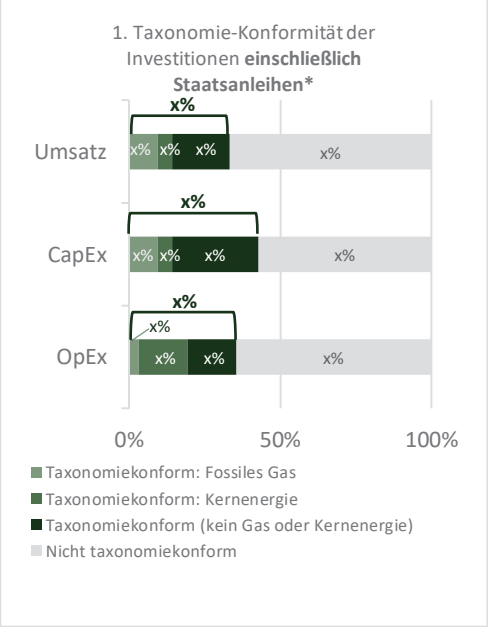
☒ Nein

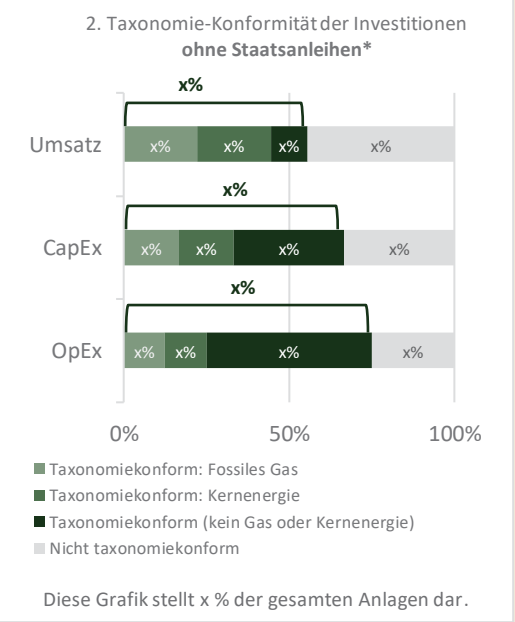
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

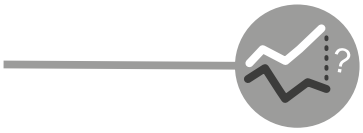
Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman InnovAsia 5G Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300VMISY5R7FEHX25

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 27,4 %* an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage *„Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“*

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufwiesen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	ES: C G:2.5	ES: A-D G: 1-4	96 %
Daten von Dritten	4,7	1-10	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 8,0 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller

klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 89 %, was einem Durchschnitt des CVaR über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %

Bezugszeitraum 2022	ES: C G: 2,2	4,3	86 %
Bezugszeitraum 2023	ES:C G: 2,5	4,7	96 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verschlechtert und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das Rating externer Anbieter verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-5,3 %	87 %
Bezugszeitraum 2023	-8,0 %	89 %

Die CVaR-Prognose hat sich im Vergleich zum Vorjahr aufgrund einer verbesserten Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und der Handelsaktivitäten im Portfolio verändert. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

3. Ausschlüsse

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

  Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf

die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser

Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

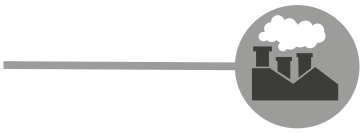
Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SK HYNIX INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,0 %	Repbulik Korea
HARMONIC DRIVE SYSTEMS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,7 %	Japan
FABRINET	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,6 %	Thailand
JENTECH PRECISION INDUSTRIAL LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,6 %	Taiwan (Republik China)
ACCTON TECHNOLOGY CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	Taiwan (Republik China)
AEM HOLDINGS LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,9 %	Singapur
EMEMORY TECHNOLOGY INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,8 %	Taiwan (Republik China)
SMC (JAPAN) CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,8 %	Japan
JMDC INC	J – Information und Kommunikation	2,7 %	Japan
SANSAN INC	J – Information und Kommunikation	2,5 %	Japan
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	Taiwan (Republik China)
MERCARI INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,4 %	Japan
ROHM LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	Japan
E INK HOLDINGS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,3 %	Taiwan (Republik China)
FPT CORP	J – Information und Kommunikation	2,3 %	Vietnam

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

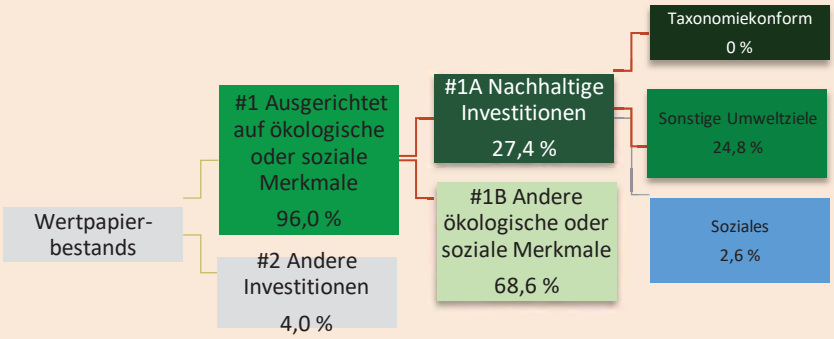
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,0 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 10 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 27,4 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und

keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,0 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	69,5 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,5 %

J – Information und Kommunikation	18,7 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,3 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	2,4 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,5 %
P – Erziehung und Unterricht	1,7 %
Keine	1,3 %

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

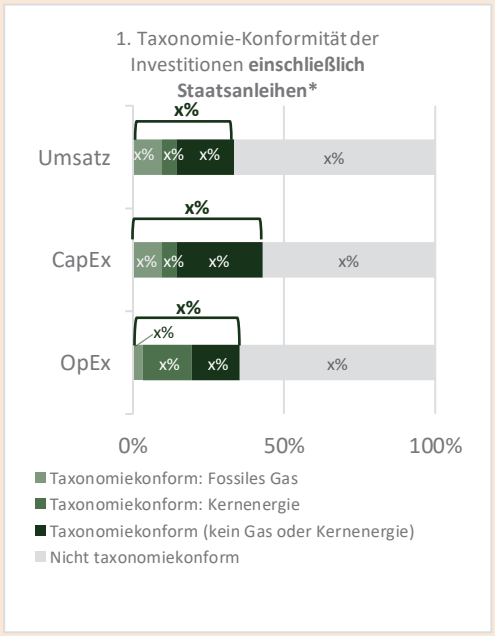
☒ Nein

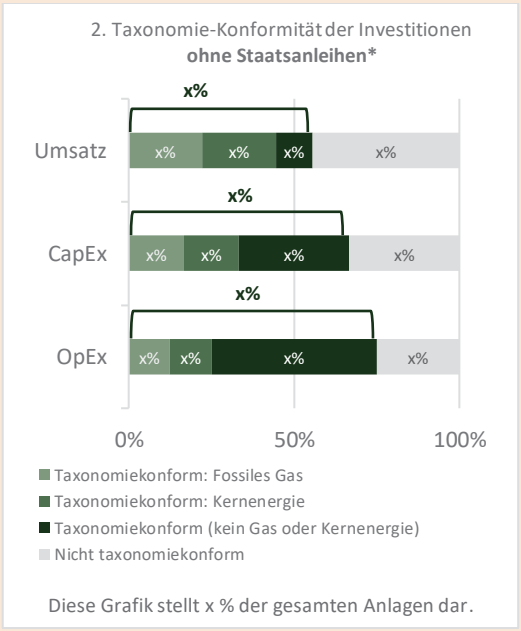
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 24,8 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 2,6 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Entwicklung des Themas „Innovative Technologies“ fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

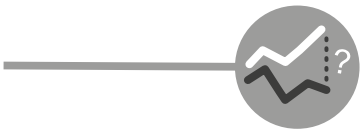
II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Japan Equity Engagement Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300ELGQMFUUPHG878

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Alle Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben zudem die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung dieser ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.
- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit der hausinternen NB-ESG-Bewertung gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung:

   Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte als Teil des Anlageprozesses verschieden ökologische und soziale Merkmale für sein Bewertungsmodell. Der Sub-Investment-Manager griff auf eine hausinterne ESG-Bewertung von Neuberger Berman („**NB**") zurück, der an den japanischen Markt angepasst wurde. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung berücksichtigte in ihrem Bewertungsmodell außerdem das Mitwirkungspotenzial. Ferner berücksichtigte die hausinterne NB-ESG-Bewertung die von der Wesentlichkeitsmatrix von NB identifizierten ökologischen und sozialen Merkmale, die auf dem Wesentlichkeitsrahmen des Sustainability Accounting Standards Board („**SASB**") basieren. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB konzentrierte sich auf die ESG-Merkmale, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden.

   Grundlage für die hausinterne NB-ESG-Bewertung von NB ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von NB. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB konzentrierte sich auf die ESG-Merkmale, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wird.

   Die hausinterne NB-ESG-Bewertung gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren für jeden Sektor, um davon eine hausinterne NB-ESG-Bewertung für Unternehmen abzuleiten, die im Portfolio gehalten werden. Unternehmen mit einer günstigen und/oder sich verbessernden hausinternen NB-ESG-Bewertung erhalten eine höhere Punktzahl, was bei der Erhöhung der Gewichtung der Unternehmen im Portfolio ein wesentlicher Gesichtspunkt war. Unternehmen mit einer schlechten hausinternen NB-ESG-Bewertung, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit mit einer niedrigeren Bewertung versehen, wodurch die Gewichtung eines Unternehmens im Portfolio verringert werden konnte. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei im Portfolio gehaltenen Unternehmen Vorrang einzuräumen, um deren Bemühungen bei der Bewältigung wesentlicher Belange zu unterstützen, die der Sub-Investment-Manager für die unternehmerischen Fundamentaldaten und das langfristige Wachstum des Unternehmens, einschließlich ökologischer und sozialer Belange als ausschlaggebend erachtete. Der Erfolg der konstruktiven Mitwirkungsbemühungen des Sub-Investment-Managers gegenüber den Emittenten hängt davon ab, wie offen die Emittenten sind und wie sie auf eine solche Mitwirkung reagieren.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
Interne NB-ESG-Bewertung	ES: 7,7 G: 7,7	ES: 1-15 G:1-15	98 %
Daten von Dritten	5,5	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Im Hinblick auf die hausinterne NB-ESG-Bewertung wurde ein separates Rating zwischen 1 und 15 für ökologische und soziale Merkmale („**ES**“) sowie zur Bewertung der Governance („**G**“) verwendet, wobei 15 dem höchsten und 1 dem niedrigsten Rating entspricht. Für dieses Portfolio gibt es keine hausinterne NB-ESG-Mindestbewertung, die ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Die durchschnittliche hausinterne NB-ESG-Bewertung ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 21,8 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als

Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 77 %. Diese Deckung ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus der hausinternen NB-ESG-Bewertung und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Interne NB-ESG-Bewertung

	Interne NB-ESG-Bewertung	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES:1-15 G: 1-15	0-10	0-100 %

Bezugszeitraum 2022	ES: 8,1 G: 8,5	5,1	100 %
Bezugszeitraum 2023	ES: 7,7 G: 7,7	5,5	98 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die hausinterne NB-ESG-Bewertung verschlechtert, und die Bewertung der Daten Dritter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-20,7 %	90 %
Bezugszeitraum 2023	-21,8 %	77 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios ist im Vergleich zum Vorjahr zurückgegangen. Zurückzuführen ist dies auf die Handelsaktivität und Datenbeschränkungen. Der CVaR wird nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und ist stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die es ausreichende und zuverlässige Daten gibt.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

k.A.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten. Dessen ungeachtet war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
OKINAWA CELLULAR TELEPHONE	J – Information und Kommunikation	5,0 %	Japan
FP PARTNER INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	4,3 %	Japan
TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP	F – Baugewerbe/Bau	3,8 %	Japan
AMADA LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,7 %	Japan
DAIWA INDUSTRIES LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,5 %	Japan
JSB LTD	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,4 %	Japan
RICOH LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,3 %	Japan
SHOEI LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,2 %	Japan
USS LTD	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,0 %	Japan
OPEN UP GROUP INC	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,9 %	Japan
OSAKA SODA LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,6 %	Japan
NIFCO INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	Japan
PILOT CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	Japan
YAMANASHI CHUO BANK LTD	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,2 %	Japan
TRANSACTION LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,1 %	Japan

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

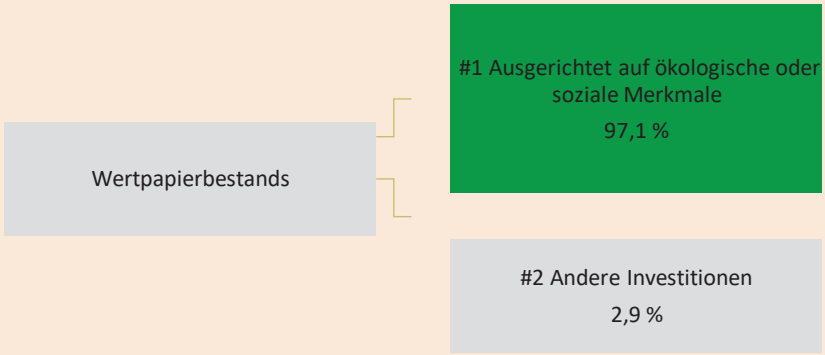
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,1 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,9 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder eine hausinterne NB-ESG-Bewertung oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	43,6 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	2,1 %
F – Baugewerbe/Bau	4,5 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	7,0 %
H - Verkehr und Lagerei	2,3 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,6 %
J – Information und Kommunikation	14,8 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	12,4 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,4 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	0,4 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	4,7 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,7 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,7 %

Keine	0,8 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

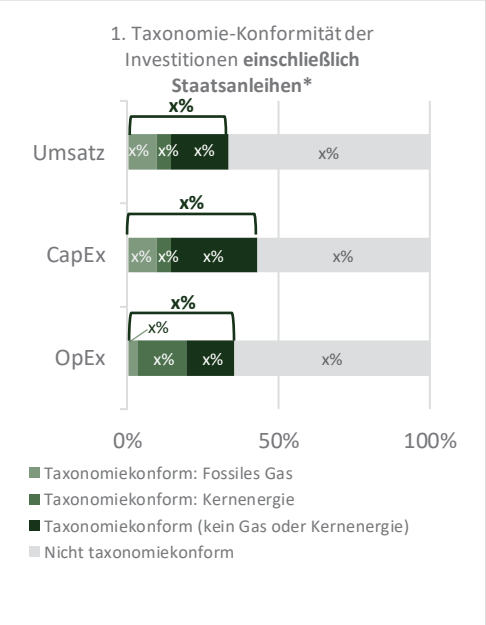
☒ Nein

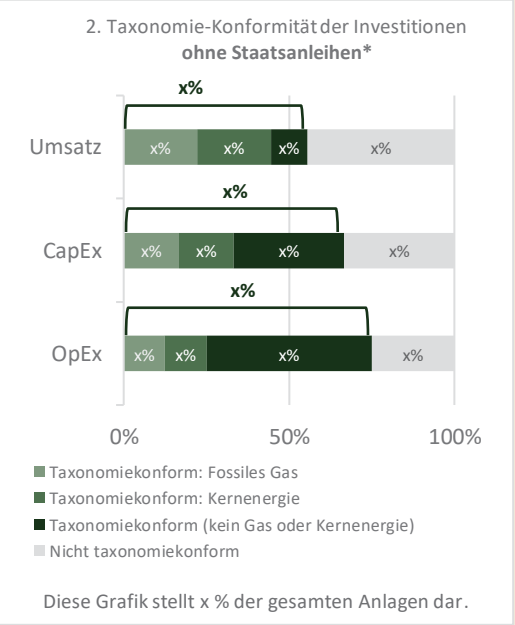
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) die hausinterne NB-ESG-Bewertung sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Für Belange der ökologischen und sozialen Verantwortlichkeit verfolgte der Sub-Investment-Manager über die hausinterne NB-ESG-Bewertung einen Top-down-Ansatz. Die hausinterne NB-ESG-Bewertung nutzte die Wesentlichkeitsmatrix von NB, um diejenigen Nachhaltigkeitsfaktoren zu identifizieren, die eine wesentliche Auswirkung auf die Nachhaltigkeit des Unternehmens gehabt haben könnten. Anschließend analysierte der Sub-Investment-Manager diese Belange im Hinblick auf das Geschäftsmodell, die Wertschöpfungskette, die Wachstumsphase des jeweiligen Unternehmens und dessen Wettbewerbsposition, um vorrangige Probleme zu identifizieren, die umgehend angegangen werden mussten. Dies geschah anhand von Recherchen vor Ort, bei der über mehrere Jahre öffentlich zugängliche Unternehmensinformationen durchforstet wurden, sowie Gesprächen mit dem Unternehmen, Konkurrenten, Lieferanten, Kunden und externen Researchanbietern, sofern durchführbar.

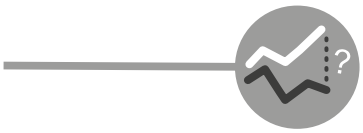
II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Sobald das Portfolio in ein Unternehmen investiert hat, setzt der Sub-Investment-Manager ein Mitwirkungsziel und eine individuelle Strategie fest, um die im Rahmen des Bewertungsprozesses identifizierten wesentlichen Belange finanzieller Art anzugehen. Die Zusammenarbeit des Sub-Investment-Managers mit Portfoliobeständen zielte darauf ab, diesen Unternehmen zu helfen, ein langfristiges Wachstum zu generieren. Als langfristiger Anleger mit Fokus auf die Bottom-up-Aktienauswahl war der Sub-Investment-Manager der Ansicht, dass er mittels eines tiefgreifenden Dialogs über das Kapitalmanagement, Umwelt- und Sozialthemen von finanzieller Wesentlichkeit sowie die Corporate Governance das jeweilige Unternehmen dabei unterstützte, ein langfristiges Wachstumsprofil aufrechtzuerhalten, was letztlich einen Performancebeitrag für das Portfolio leistete. Die Erfahrung des Sub-Investment-Managers bei der Zusammenarbeit mit Unternehmen zeigt, dass kleinere Unternehmen mehr Zeit und Ressourcen zur Bewältigung dieser Themen in Anspruch nehmen (im Durchschnitt zwei bis drei Jahre für Umwelt- und Sozialthemen). In Anbetracht dieses relativ langwierigen Prozesses führte der Sub-Investment-Manager ein System der Meilensteine ein, um sicherzustellen, dass die Mitwirkung weiterhin das gewünschte Ziel erbringt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Next Generation Mobility Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 5493000YD3J3W1CMMU74

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 47,5 %* an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Investitionen) im Sinne der EU-Taxonomie

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,3	ES: A-D G: 1-4	93 %
Rating der Daten durch externe Anbieter	7,1	0-10	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,0 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 92 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G:1- 4	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	ES: B G: 2,2	6,7	99 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B G:2.3	7,1	93 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verschlechtert und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung des NB-ESG-Quotienten und des externen Ratings aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verlagert.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-3,6 %	93 %
Bezugszeitraum 2023	-5,0 %	92 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

  Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

  Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

  Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

  Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen

	PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit". Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

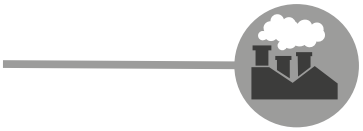
Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

i. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
ii. *Der* Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind

Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
AMPHENOL CORP CLASS A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,8 %	USA
ANSYS INC	J – Information und Kommunikation	3,4 %	USA
ANALOG DEVICES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,1 %	USA
LINDE PLC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	USA
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	J – Information und Kommunikation	3,0 %	USA
NVIDIA CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	USA
TRIMBLE INC	J – Information und Kommunikation	2,8 %	USA

TE CONNECTIVITY LTD	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,8 %	USA
CATERPILLAR INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,7 %	USA
SCHNEIDER ELECTRIC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,6 %	USA
ASML HOLDING ADR REPRESENTING NV	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,6 %	Niederlande
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	USA
APPLIED MATERIAL INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,4 %	USA
T MOBILE US INC	J – Information und Kommunikation	2,3 %	USA
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,2 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

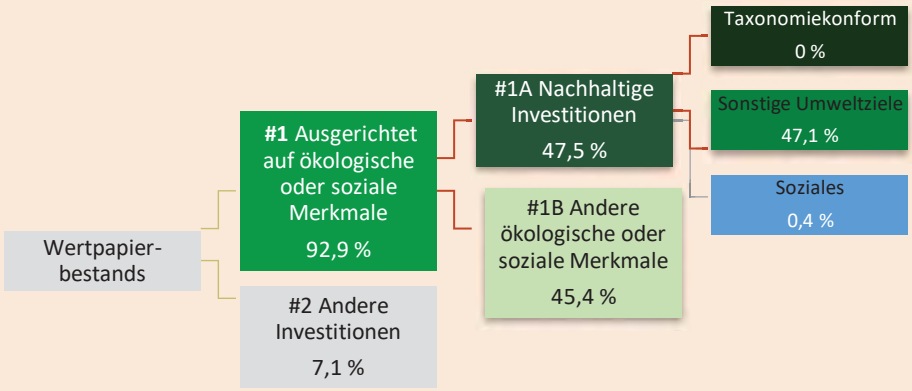
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 92,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio verpflichtet sich, mindestens 10 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 47,5 % an nachhaltigen Investitionen.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 7,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,5 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	72,8 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,5 %
J – Information und Kommunikation	19,8 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,0 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,5 %

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

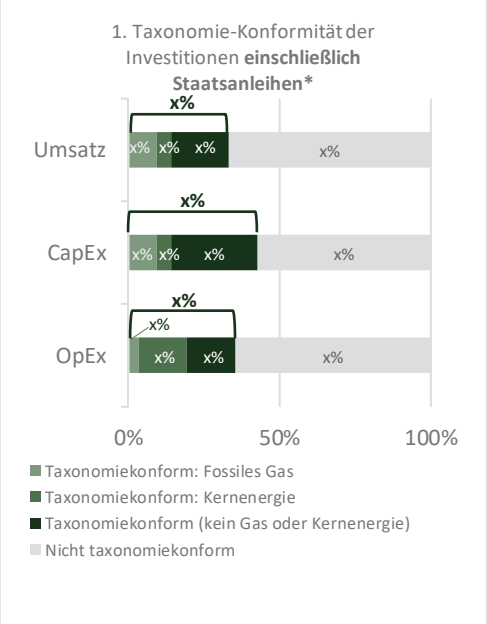
☒ Nein

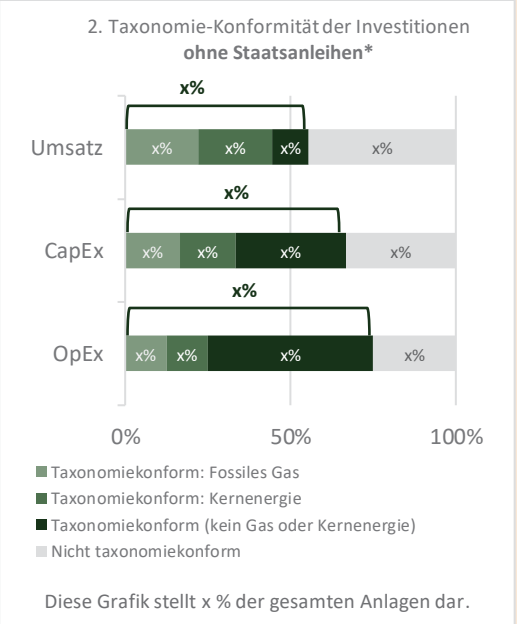
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 47,1 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 0,4 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

ESG-Merkmale werden auf drei verschiedenen Ebenen berücksichtigt:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Entwicklung des Themas „Next Generation Mobility“ fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

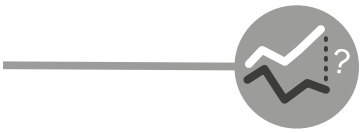
II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Next Generation Space Economy Fund (das „**Portfolio**“)
Unternehmenskennung: 549300FT24ZYHNJCVO63

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 31,0 %* an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltige Investitionen) finden Sie unter der Frage *„Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“*

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**“)*, Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

  *In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewirbt der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO2-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.[1] Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und werden im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**“), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB

[1]Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Unternehmens oder durch Fahrzeuge im Besitz des Unternehmens ergeben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Unternehmen verbraucht werden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Unternehmens anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Unternehmen verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient- oder externes Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,6	ES: A-D G: 1-4	
Daten von Dritten	6,5	0-10	95 %

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale (ES) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten

auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 7,1 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 94 %, was einem Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht mehr in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

- ***… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?***

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige

Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	ES: B G: 2,7	6,2	97 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B G: 2,6	6,5	95 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

Die Bewertung G-Ratings des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Rating der Unternehmen.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-4,0 %	82 %
Bezugszeitraum 2023	-7,1 %	94 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat, wie nachstehend erläutert, und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Unternehmens, um festzustellen, ob das Unternehmen einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Unternehmens auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Unternehmen auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Unternehmen dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Unternehmen zur Wirtschaft.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhaus-gas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Unternehmen, die unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene hing von der Verfügbarkeit angemessener, zuverlässiger und überprüfbarer Daten für diese Indikatoren ab. Stehen solche Daten nicht zur Verfügung, werden die PAIs auf Produktebene erst dann berücksichtigt, wenn diese Daten verfügbar sind. Der Sub-Investment-Manager wird die Liste der von ihm berücksichtigten PAIs auf Produktebene einer aktiven Überprüfung unterziehen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,4 %	USA
INTELLIAN TECHNOLOGIES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,5 %	Repbulik Korea
ROCKET LAB USA INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,3 %	USA
SAFRAN SA	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,1 %	Frankreich
QUALCOMM INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	USA
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,0 %	Singapur
AIRBUS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,9 %	Frankreich
TRANSDIGM GROUP INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,7 %	USA
TRIMBLE INC	J – Information und Kommunikation	2,7 %	USA
NVIDIA CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,6 %	USA
ADVANCED MICRO DEVICES INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,6 %	USA
BOEING	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	USA
DEERE & CO	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	USA
AMAZON COM INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,3 %	USA
MOTOROLA SOLUTIONS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,3 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

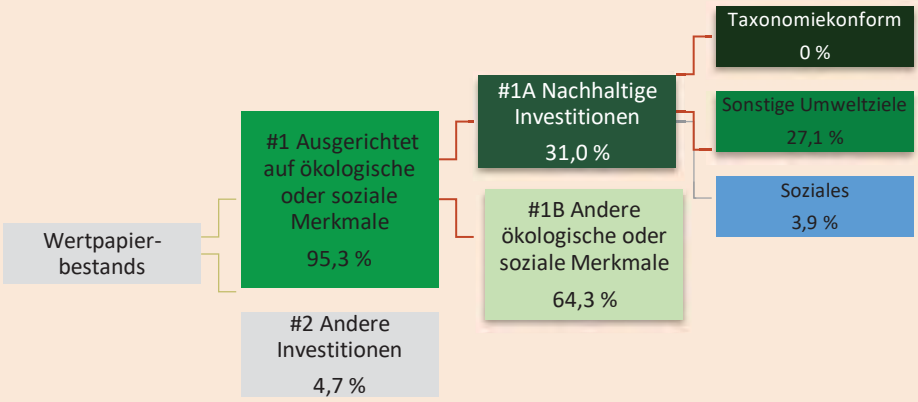
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 95,3 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio verpflichtete sich, mindestens 10 % nachhaltige Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 31,0 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,7 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.
#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:
- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	68,0 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,4 %
J – Information und Kommunikation	24,3 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,7 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	3,5 %

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[2]?

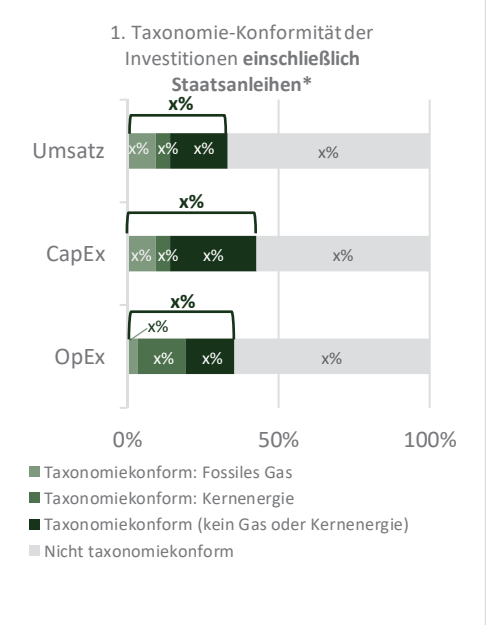
☐ Ja:
- ☐ In fossiles Gas
- ☐ In Kernenergie

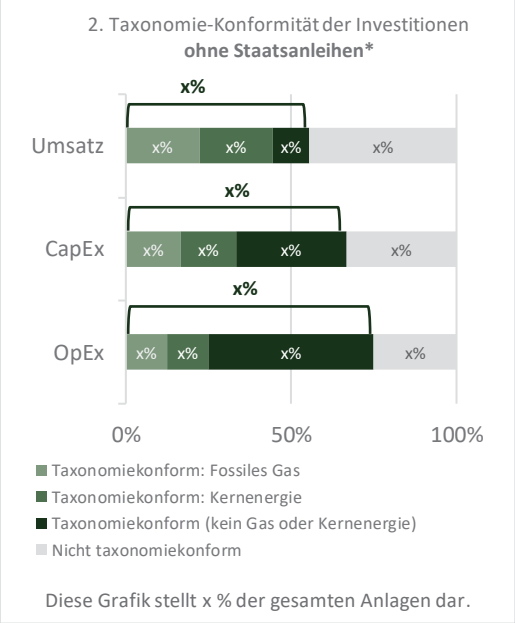
☒ Nein

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

[2] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





* *Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 27,1 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 3,9 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das externe oder NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung eines Unternehmens besser zu erkennen, wobei darauf hingewiesen wird, dass der Schwerpunkt des Portfolios auf Investitionen in Unternehmen liegt, welche die Entwicklung des Themas „Next Generation Space Economy" fördern.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die thematische Beurteilung und die Gesamtbeurteilung des Unternehmens bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Responsible Asian Debt – Hard Currency Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 54930058PUF4SZOVOD17

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 48,0 %** an nachhaltigen Investitionen***
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Mit Wirkung vom 2. Oktober 2023 änderte der Neuberger Berman Asian Debt – Hard Currency Fund seinen Namen in Neuberger Berman Responsible Asian Debt – Hard Currency Fund.

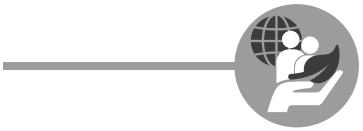
**Das Portfolio führte zum 2. Oktober 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 20 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände zum 31. Dezember 2023 (als das einzige Quartalsende nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

***Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**"). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmen beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO2-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen (**„THG"**) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

  Das Portfolio erreichte eine CO2-Emissionsintensität, die mindestens 10 % unter derjenigen des breiteren Anlageuniversums asiatischer Schuldtitel lag, das bis zum 2. Oktober 2023 durch den JP Morgan Asian Credit Index (Total Return, USD) (der „**Referenzwert**") repräsentiert wurde. Nach einer Erhöhung des Reduktionsziels (von 10 % auf 30 %) ab dem 2. Oktober 2024 erreichte das Portfolio eine Emissionsintensität, die mindestens 30 % unter derjenigen des breiteren Anlageuniversums für asiatische Schuldtitel lag. Das Portfolio wird aktiv verwaltet und beabsichtigt nicht, den Referenzwert nachzubilden (zu tracken). Er wird hier lediglich zu Zwecken des Vergleichs der Wertentwicklung herangezogen.

  Für den Bezugszeitraum erreichte das Portfolio eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Schuldtitel, das durch den Referenzwert repräsentiert wird, basierend auf den ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters.

  Ab dem 2. Oktober 2023 soll das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel ausgerichtet sein. Der Sub-Investment-Manager bewarb und bewirbt künftig die Verringerung des CO2-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.[1] Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

- ***Soziale Merkmale***: Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

[1]Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

   Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	59	1-100	100 %
Daten von Dritten	5,5	0-10	

   Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

   Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

   Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

   Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

   Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und, seit dem 2. Oktober 2023, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Das Portfolio

baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt).

Darüber hinaus wurden im Portfolio Wertpapiere aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen, die von Emittenten begeben wurden, die nachweislich an direkter Kinderarbeit beteiligt sind, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen erzielen, sowie bestimmten Emittenten mit erheblichen Umsätzen aus Palmöl, Erwachsenenunterhaltung und Atomstromerzeugung oder seit dem 6. Dezember 2023 Unternehmen, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellen oder eine Bezug zur Atomwaffenindustrie haben. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager schlossen seit dem 2. Oktober 2023

(a) Wertpapiere von Emittenten aus, die 5% oder mehr ihrer Umsätze durch folgende Aktivitäten erzielten:
- die Herstellung alkoholischer Produkte;
- die Herstellung von Material für Erwachsenenunterhaltung;
- die Herstellung von konventionellen Waffen;
- das Eigentum oder der Betrieb von mit Glücksspielen verbundenen Geschäften; oder
- die Herstellung oder der Vertrieb von Palmöl.

(b) Der Manager und der Sub-Investment-Manager schlossen Wertpapiere aus, die von Unternehmen begeben wurden, bei denen ESG-Kontroversen festgestellt wurden (unter anderem negative ESG-Auswirkungen der Geschäftstätigkeit, der Produkte und/oder Dienstleistungen des Unternehmens, Nichteinhaltung internationaler Richtlinien oder Schutzmaßnahmen (z. B. im Rahmen der Global Standards Policy)), oder von Unternehmen, die Anlass zu ernsthaften Bedenken hinsichtlich ihrer Anpassung an internationale Richtlinien oder Schutzmaßnahmen gaben.

(c) Der Manager und der Sub-Investment-Manager tätigten keine Investitionen in staatlichen Emittenten und/oder in Unternehmen, die zu 100 % in staatlicher Hand sind, bei denen der Manager und der Sub-Investment-Manager eine schwache ESG-Praxis festgestellt haben. Diese Ausschlüsse basierten auf einer Reihe von ESG-Kriterien, darunter:
- Staatliche Emittenten, die auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten im untersten Dezil rangierten und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen bestanden; oder
- Staatliche Emittenten, deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat aufgrund von Menschenrechtsverletzungen mit Sanktionen belegt wurden; oder
- Staatliche Emittenten, bei denen schlechte und sich verschlechternde Kennzahlen für Menschenrechte und Rechtsstaatlichkeit festgestellt wurden; oder
- staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht einhielten, oder staatliche Emittenten, die von der Financial Action Task Force („FATF“) als Hochrisikoland eingestuft wurden.

Durch die oben genannten Maßnahmen basierend auf ESG-Ausschlüssen haben der Manager und der Sub-Investment-Manager mindestens 20 % der Komponenten des Anlageuniversums ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	59	5,6	97 %
Bezugszeitraum 2023	59	5,5	100 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die Bewertung der Daten Dritter aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Emittenten und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios sowie aufgrund von potenziellen Änderungen oder Unterschieden im externen Rating des Emittenten verlagert. Wie bereits erwähnt, werden der Manager und der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Emittenten eintreten, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um im Laufe der Zeit eine Verbesserung im NB-ESG-Quotienten zu erreichen.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Allerdings verpflichtete sich das Portfolio ab dem 2. Oktober 2023 zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen von 20 %, welche die vorstehend aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale bewerben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält. Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

Nachhaltige Investitionen wiesen zu einer höheren Wahrscheinlichkeit eine Ausrichtung der aus Produkten/Dienstleistungen erzielten Umsätze auf die SDGs auf.

Sowohl die nachhaltigen als auch die nicht nachhaltigen Investitionen im Portfolio zielten bis 2050 auf eine Netto-Null-Ausrichtung ab.

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Ab dem 2. Oktober 2023 wandten der Manager und der Sub-Investment-Manager ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Bei der Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen kein ökologisches oder soziales nachhaltiges Anlageziel erheblich beeinträchtigten, berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) wie nachfolgend in Teil 2 der Tabelle dargelegt (zusammen die „**PAIs**“)**:**

Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
Teil 2 – staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 - THG-Emissionsintensität
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

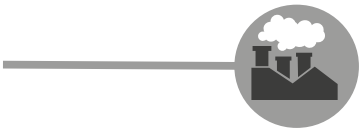
Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele führten, ab dem 2. Oktober 2023 alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen

	PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

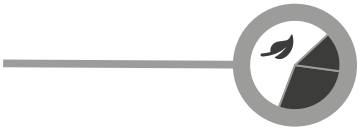
Da die nachstehende Liste auf einem über die vier Kalenderquartalsenden des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitt basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
INDONESIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,3 %	Indonesien
PERTAMINA PT RegS	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,0 %	Indonesien
INDONESIA REPUBLIC OF	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	Indonesien
INDONESIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	Indonesien
MONGOLIA (GOVERNMENT OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,1 %	Mongolei
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,9 %	Indonesien
PHILIPPINES (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,9 %	Philippinen
ENN CLEAN ENERGY INTERNATIONAL INV RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	China
STANDARD CHARTERED PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	Hongkong

SRI LANKA GOVERNMENT BOND RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,8 %	Sri Lanka
RENEW POWER PVT LTD RegS	D – Energieversorgung	0,8 %	Indien
MEDCO BELL PTE LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	Indonesien
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,7 %	Repbulik Korea
STANDARD CHARTERED PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,7 %	Hongkong
SRI LANKA (DEMOCRATIC SOCIALIST RE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,7 %	Sri Lanka

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

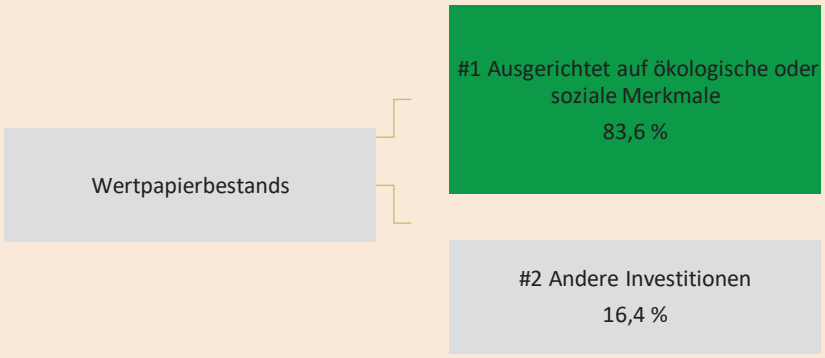
Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 83,6 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio führte zum 2. Oktober 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 20 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände zum 31. Dezember 2023 (als das einzige Quartal nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 48 % an nachhaltigen Investitionen.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 16,4 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum für die nachstehenden Daten ist ein Durchschnitt der vier Quartalsenden 2023, mit Ausnahme der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen. In

diesem Falle wurden die Daten lediglich für diesen Bezugszeitraum auf Grundlage der Portfoliobeteiligungen zum 31. Dezember 2023 erstellt.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen zum 31. Dezember 2023 betrug 48,0 %. Darin enthalten waren 38,7 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, und 9,3 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögens-werte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,0 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	8,2 %
D – Energieversorgung	6,5 %
F – Baugewerbe/Bau	2,1 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,6 %

H - Verkehr und Lagerei	2,3 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,7 %
J – Information und Kommunikation	3,3 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	50,9 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,9 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,1 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	14,7 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,5 %
Keine	1,3 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[2]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

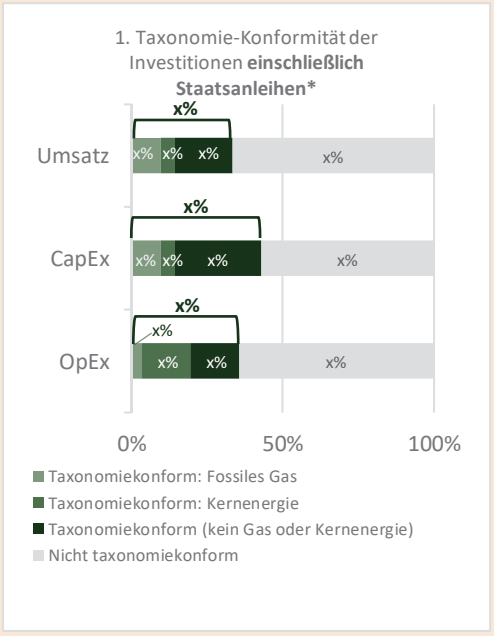
☒ Nein

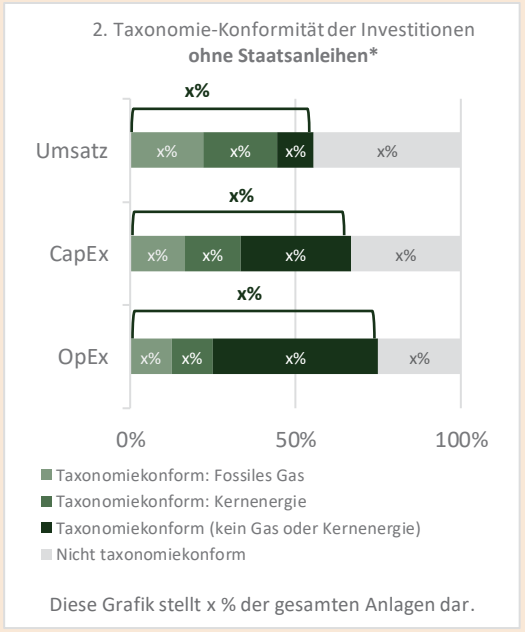
[2] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio führte zum 2. Oktober 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 20 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände zum 31. Dezember 2023 (als das einzige Quartalsende nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Zum 31. Dezember 2023 hielt das Portfolio 38,7 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio führte zum 2. Oktober 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 20 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände zum 31. Dezember 2023 (als das einzige Quartalsende nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Zum 31. Dezember 2023 hielt das Portfolio 9,3 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards

verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

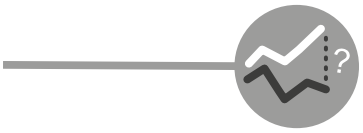
Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Short Duration Emerging Market Debt Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300J30SXW5866TW70

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 36.5 %* an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für staatliche Emittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: staatliche Energieeffizienz, Anpassung an den Klimawandel, Entwaldung, Treibhausgasemissionen (**„THG“**) , Luft- und Haushaltsverschmutzung und unsichere sanitäre Einrichtungen.

- ***Soziale Merkmale***: Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, "**SDGs**"), Gesundheits- und Bildungsniveau, Qualität der Regulierung, politische Stabilität und Freiheiten, Gleichstellung der Geschlechter sowie Forschung und Entwicklung.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale:*** Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO2-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen, umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

- ***Soziale Merkmale:*** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für Länder und Unternehmenssektoren, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten den NB-ESG-Quotienten, um die aufgeführten ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben, indem sie primär in Wertpapiere von Emittenten mit einem relativ günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotienten-Rating investierten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend beschränkten der Manager und der Sub-Investment-Manager das Engagement in Emittenten mit dem schlechtesten NB-ESG-Quotienten-Rating, außer es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotienten-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	56	1-100	98 %
Daten von Dritten	4,5	0-10	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 6. Dezember 2023 schlossen der Manager und der Sub-Investment-Manager Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellten oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie hatten. Ab dem 6. Dezember 2023 schlossen der Manager und der Sub-Investment-Manager Wertpapiere von Unternehmen aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielten. Das Portfolio untersagte außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle bezogen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandierten oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthielten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen erzielten. Emittenten, die an direkter Kinderarbeit beteiligt waren, und Emittenten, die mehr als 10 % der Umsätze aus der Ölsandgewinnung erzielten, wurden ebenfalls ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten

Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	55	4,2	95 %
Bezugszeitraum 2023	56	4,5	98 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartige Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („**SDGs**“).

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei staatlichen Emittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf folgenden Arten erfasst:

- Fortschritte bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz und
- Fortschritte bei der Erreichung der SDGs, mit Schwerpunkt auf Lebenserwartung und Bildung

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wandten ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Bei der Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Anlagen kein ökologisches oder soziales nachhaltiges Anlageziel erheblich beeinträchtigten, berücksichtigten der Manager und der Sub-Investment-Manager die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“) und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen für staatliche Emittenten (wie nachfolgend in Teil 2 der Tabelle im Abschnitt „*Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?*“ dargelegt) (die „**staatlichen PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs und staatlichen PAIs berücksichtigt.

2. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**“) (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**“) aufgeführt sind:

Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen
Teil 2 – staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 - THG-Emissionsintensität
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;

- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und

- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
SERBIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,7 %	Republik Serbien
REPUBLIC OF COLOMBIA	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,5 %	Kolumbien
SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC RegS	H - Verkehr und Lagerung	1,2 %	Aserbaidschan
BRAZIL MINAS SPE RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,2 %	Brasilien
ANGOLA GOVERNMENT BOND RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,1 %	Angola
PETROLEOS MEXICANOS	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,0 %	Mexiko
QNB FINANCE LTD MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,0 %	Katar
EASTERN AND SOUTHERN AFRICAN TRADE MTN RegS	U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,0 %	Supranational
COLOMBIA GOVERNMENT BOND	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,9 %	Kolumbien
SAUDI ARABIAN OIL CO MTN RegS	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,9 %	Saudi-Arabien
KOREA MINE REHABILITATION AND MINE RegS	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,9 %	Repbulik Korea
SASOL FINANCING USA LLC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	Südafrika
ARAB REPUBLIC OF EGYPT MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,8 %	Ägypten
DOMINICAN REPUBLIC RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,8 %	Dominikanis Republik
ROMANIA (REPUBLIC OF) MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	0,7 %	Rumänie

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögens-werten an.

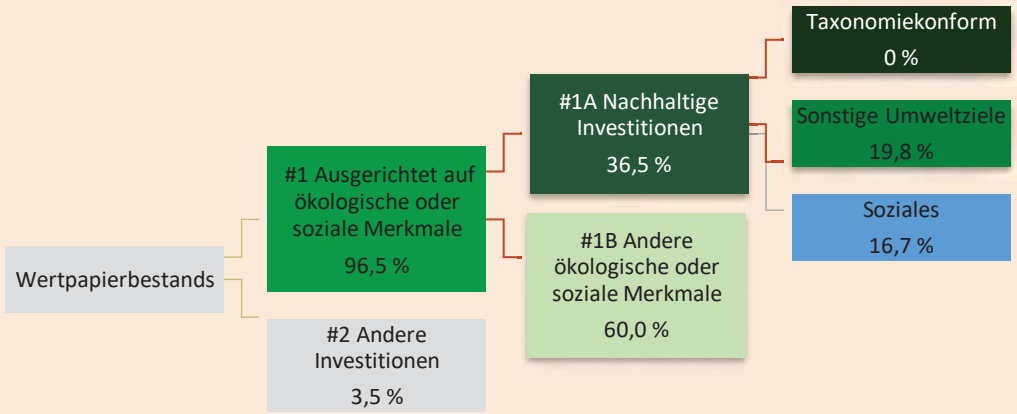
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio verpflichtete sich, mindestens 10 % nachhaltige Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums 2023 hielt das Portfolio 36,5 % an nachhaltigen Investitionen.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,5 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:
- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	9,1 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,7 %
D – Energieversorgung	3,6 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,0 %
F – Baugewerbe/Bau	0,8 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,4 %
H - Verkehr und Lagerei	2,7 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,6 %
J – Information und Kommunikation	0,3 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	48,9 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,7 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,1 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,6 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	27,2 %

R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,7 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	1,3 %
Keine	0,2 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

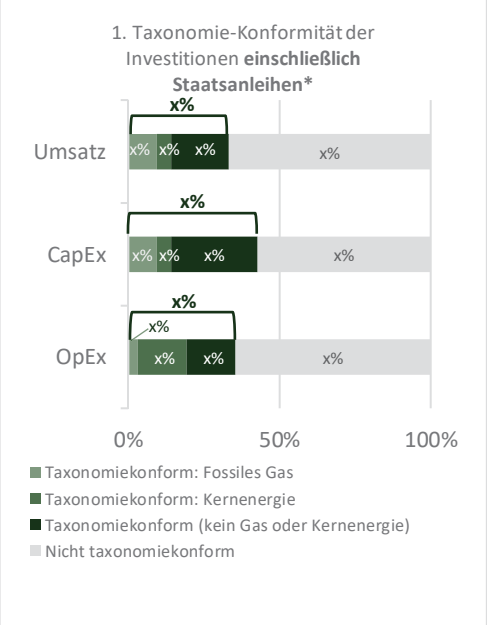
☒ Nein

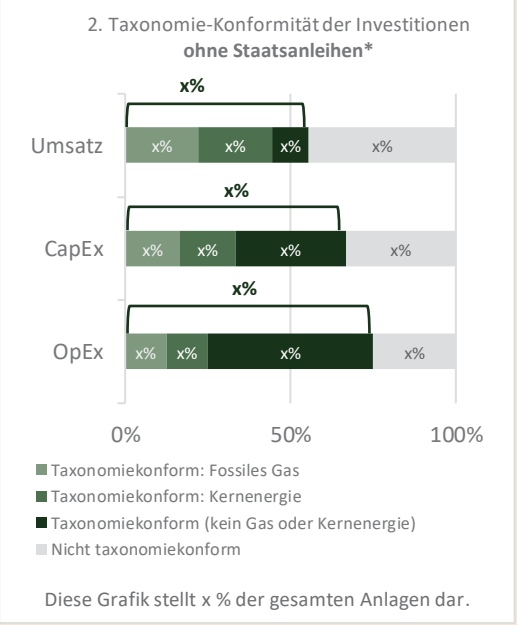
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 19,8 % an nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 16,7 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

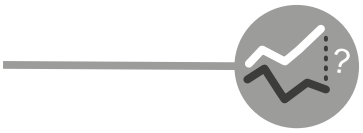
II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Short Duration High Yield SDG Engagement Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 5493009EN8Z7034TFP15

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 28,8* % an nachhaltigen Investitionen**
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

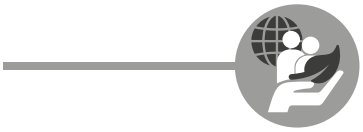
*Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

**Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Das Portfolio war bestrebt, die Verwirklichung der UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“) zu bewerben, indem mit mindestens 90 % der Emittenten (innerhalb von zwölf Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere) Kontakt aufgenommen und Maßnahmen besprochen wurden, die sie im Rahmen ihrer Produkte, Dienstleistungen, betrieblichen Abläufe oder Prozesse ergreifen können und die mit diesen Zielen in Einklang stehen (oder wo das Potenzial besteht, dass nach einer Zusammenarbeit mit diesen Unternehmen eine stärkere Ausrichtung auf diese Ziele erreicht wird).

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks*, Treibhausgasemissionen („**THG**“), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, Recycling-Praktiken und -Trends, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

  Um das Portfolio auf ein Null-Nettoziel auszurichten, bewarb und bewirbt der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO2-Fußabdrucks des Portfolios in den Scope-1-, Scope-2- und wesentlichen Scope-3-THG-Emissionen[1]. Damit soll das Ziel des Portfolios erreicht werden, bis 2030 eine Verringerung um 50 % im Vergleich zu einem als Basiswert angenommenen Jahr (2019) und einen anschließenden Rückgang auf Null netto bis 2050 erreicht werden. Das Basisjahr 2019 kann neu berechnet werden, wenn sich die Datenqualität und die Offenlegung im Laufe der Zeit verbessern, insbesondere in Bezug auf die Scope-3-Emissionen.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen zur Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Der Sub-Investment-Manager hielt für den Berichtszeitraum ein durchschnittliches ESG-Rating für das Portfolio aufrecht, das besser war als das des breiten US-Hochzinsmarktes, der durch den ICE BofA U.S. High Yield Index repräsentiert wird, was auf der Grundlage von ESG-Ratings Dritter von einem etablierten externen Anbieter bewertet wurde. Der Bezugszeitraum ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden. Das Portfolio wurde aktiv verwaltet, der ICE BofA U.S. High Yield Index wurde ausschließlich zum Vergleich von ESG-Ratings und der Reduzierung der Kohlenstoffintensität verwendet.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

[1]Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von NB, die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kamen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wurde.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden aus dem Portfolio entfernt.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	57	1-100	100 %
Daten von Dritten	5,6	0-10	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit:

Wie oben erwähnt, trug der Sub-Investment-Manager zur Erreichung der SDGs bei, indem er mit mindestens 90 % der Unternehmensemittenten in Kontakt trat (die zum 31. Dezember 2023 für mindestens zwölf Monate im Portfoliobestand waren).

Der Sub-Investment-Manager hat außerdem nachfolgend eine Zusammenfassung seiner Bemühungen zur Einflussnahme im Kalenderjahr 2023 beigefügt.

Der Sub-Investment-Manager trat mit 161 im Portfolio gehaltenen Unternehmen während des Bezugszeitraus in Kontakt.
54 % dieser Dialoge des Sub-Investment-Managers waren direkte Einzelgespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch).
51 % der Gespräche des Sub-Investment-Managers fanden mit Mitarbeitern und Mitarbeiterinnen der CEO-/CFO-Ebene statt.
15 der insgesamt 17 UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung (Sustainable Development Goals, „SDG“) wurden vom Sub-Investment-Manager während seiner Zusammenarbeit mit den Unternehmen abgedeckt.
22 % der Unternehmen, mit denen im Bezugszeitraum zusammengearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen.

Weitere Informationen über die Einflussnahme durch den Sub-Investment-Manager finden sich in der Bericht des Portfolios über die Zusammenarbeit hier.

3. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**“) das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 11,6 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 59 %, was aus dem Durchschnitt der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet wurde.

Die Analyse des CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

4. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Das Portfolio hat Emittenten ausgeschlossen, die an umstrittenen Tätigkeiten und Verhaltensweisen beteiligt waren, darunter Hersteller von Pelz, Glücksspielunternehmen und im Bereich Kernkraft tätige Unternehmen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %

Bezugszeitraum 2022	57	5,3	100 %
Bezugszeitraum 2023	57	5,6	100 %

Im Vergleich zum Vorjahr ist die Bewertung des NB-ESG-Quotienten unverändert geblieben und die Bewertung der Daten Dritter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

2. Berichterstattung über die Zusammenarbeit

	Unternehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde	**% der Dialoge waren direkte Einzel-gespräche (entweder per Fernzugriff oder als persönliches Gespräch)**	**% der Dialoge erfolgten mit Mitarbeiter/ innen auf CEO/CFO-Ebene**	**Anzahl der abgedeckten SDGs (von 17)**	**% der Unter-nehmen, mit denen zusammen-gearbeitet wurde, haben das Ziel dieser Mitwirkung entweder vollständig erreicht oder teilweise Maßnahmen zur Erreichung ihres Ziels ergriffen.**
Bezugs-zeitraum 2022	114	65 %	48 %	14	16 %
Bezugs-zeitraum 2023	161	54 %	51 %	15	22 %

3. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-12,4 %	60 %
Bezugszeitraum 2023	-11,6 %	59 %

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

4. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es während des Bezugszeitraums kein nachhaltiges Anlageziel. Seit dem 2. August 2023 hat sich das Portfolio dazu verpflichtet, mindestens 10 % nachhaltige Investitionen zu halten. Die nachhaltigen Investitionen bewarben die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Der Sub-Investment-Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Seit dem 2. August 2023 wendet der Sub-Investment-Manager seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit". Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

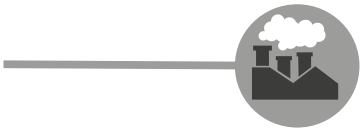
Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.
2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind

Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die o. g. PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
XHR LP 144A	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,3 %	USA
AVIENT CORP 144A	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,0 %	USA
GEN DIGITAL INC 144A	J – Information und Kommunikation	1,0 %	USA
STANDARD INDUSTRIES INC (DELAWARE) 144A	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,0 %	USA
APX GROUP INC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	USA
SOLARIS MIDSTREAM HOLDINGS LLC 144A	H - Verkehr und Lagerung	0,9 %	USA
AMERICAN AIRLINES INC 144A	H - Verkehr und Lagerung	0,9 %	USA
PERFORMANCE FOOD GROUP INC 144A	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,9 %	USA
GENESIS ENERGY LP	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,9 %	USA
TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	Niederlande
PARK INTERMEDIATE HOLDINGS LLC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	USA
ASSUREDPARTNERS INC 144A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,8 %	USA

AMERICAN AIRLINES INC 144A	H - Verkehr und Lagerung	0,8 %	USA
RLJ LODGING TRUST LP 144A	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,8 %	USA
CAMELOT RETURN MERGER SUB INC 144A	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,8 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

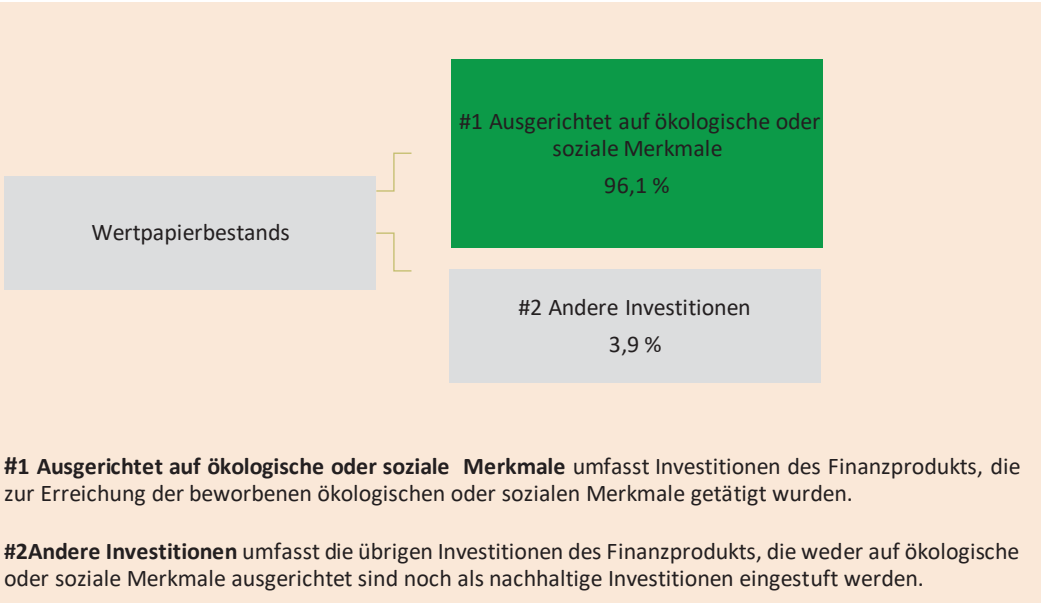
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,1 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in diesem periodischen Bericht wurden daher auf Grundlage der Portfoliobestände als Durchschnitt zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 28,8 % an nachhaltigen Investitionen.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,9 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum für die nachstehenden Daten ist ein Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden, mit Ausnahme der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen. In diesem Falle wurden die Daten lediglich für diesen Bezugszeitraum auf Grundlage des Durchschnitts zum Ende des dritten und vierten Quartals erstellt.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen als Durchschnitt des dritten und vierten Quartals 2023 beträgt 28,8 %. Darin enthalten sind 17,5 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind, und 11,3 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	7,0 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	17,8 %
D – Energieversorgung	2,6 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,5 %
F – Baugewerbe/Bau	2,7 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	6,3 %
H - Verkehr und Lagerei	9,7 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,4 %
J – Information und Kommunikation	13,7 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	19,4 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,2 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,0 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	7,4 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	3,2 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,3 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,0 %
Keine	2,8 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[2]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

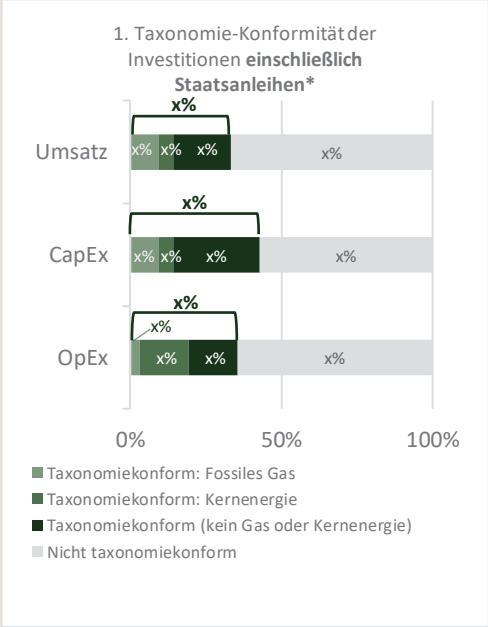
☒ Nein

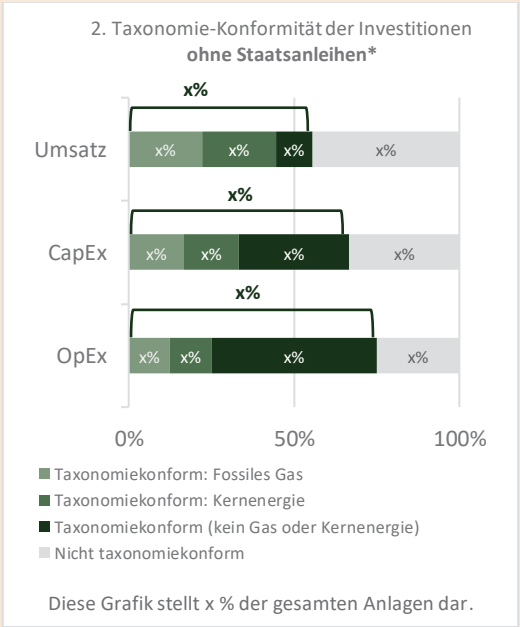
[2] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 17,5 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 10 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts zum dritten und vierten Quartalsende des Bezugszeitraums (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 11,3 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses.

Dieses Programm konzentrierte sich auf persönliche Treffen und Telefonkonferenzen, um die ESG-Risiken und -Chancen zu verstehen und die gute Unternehmensführung der Emittenten zu bewerten. Im Rahmen der direkten Zusammenarbeit hat der Sub-Investment-Manager Ziele festgelegt, welche Ziele die Emittenten erreichen sollten. Diese Ziele sowie die Fortschritte der Emittenten im Hinblick auf diese Ziele wurden vom Sub-Investment-Manager mit Hilfe eines internen Systems von NB zur Nachverfolgung der Mitwirkung erfasst und überwacht (weitere Einzelheiten sind dem obigen Abschnitt über die Mitwirkung zu entnehmen).

Das Portfolio:

- Bestrebt, die Verwirklichung der SDGs zu bewerben, indem darauf abgezielt wurde, mit mindestens 90 % der Emittenten (innerhalb von zwölf Monaten im Anschluss an den Kauf der von dem Unternehmensemittenten begebenen Wertpapiere) Kontakt aufzunehmen und Maßnahmen zu besprechen, die sie im Rahmen ihrer Produkte, Dienstleistungen, betrieblichen Abläufe oder Prozesse ergreifen könnten und die mit diesen Zielen in Einklang stehen (oder wo das Potenzial besteht, dass nach einer Zusammenarbeit mit diesen Emittenten eine stärkere Ausrichtung auf diese Ziele erreicht wird).

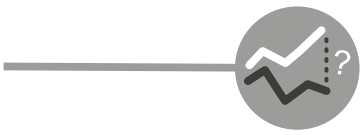
- Hielt ein durchschnittliches ESG-Rating für das Portfolio aufrecht, das besser war als das des breiten US-Hochzinsmarktes, der durch den ICE BofA U.S. High Yield Index repräsentiert wird und der auf der Grundlage von ESG-Ratings Dritter von einem etablierten externen Anbieter bewertet wurde. Diese Berechnung basierte auf dem ESG-Rating des Portfolios zum Ende eines jeden der vier Kalenderquartalen im Bezugszeitraum.

Der Sub-Investment-Manager nutzte ein hausinternes Instrument, um im Vorfeld einer Anlage die Wahrscheinlichkeit auf Erfolg bei der Mitwirkung gegenüber einem Emittenten festzustellen (der „**Mitwirkungspotenzial-Indikator**“). Der Mitwirkungspotenzial-Indikator bietet auf einer Skala von 1–5 eine systematische Bewertung der Bereitschaft und Fähigkeit eines Emittenten, mit dem Sub-Investment-Manager zu den SDGs zusammenzuarbeiten. Ein Emittent, der beispielsweise als nicht bereit oder fähig zur Zusammenarbeit eingestuft wurde, erhielt einen Mitwirkungspotenzial-Indikator von „1“, während ein Emittent, der zur Zusammenarbeit bereit war, um ein Vorreiter bei der Unterstützung der SDGs zu werden, mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator von „5“ bewertet wurde. Der Sub-Investment-Manager priorisierte Anlagen in Emittenten mit einem Mitwirkungspotenzial-Indikator zwischen „2“ und „5“. Mit dem Mitwirkungspotenzial-Indikator wurden neben den finanziellen Beschränkungen für den Emittenten verschiedene Faktoren berücksichtigt, darunter die Bedeutung der SDGs im Geschäftsbetrieb des Emittenten, die Offenlegungspraktiken des Emittenten und die Beziehung des Sub-Investment-Managers zum Emittenten.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Strategic Income Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300RBLDK0PHH13M43

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hauseigene Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („**NB**"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die als wahrscheinlichste wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Portfolio-Analystenteams genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existierte kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	71	1-100	48 %
Daten von Dritten	6,0	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 8,7 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 20 %, was einem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden oder nicht mit dieser vereinbar waren, die solche Emittenten ausschließt, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Emittenten von Unternehmensanleihen aus den Schwellenländern aus, die in der Tabakindustrie tätig und an Kinderarbeit beteiligt waren.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlage des Portfolios).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	72	5,7	66 %
Bezugszeitraum 2023	71	6,0	48 %

Das NB-ESG-Quotient-Rating hat sich im Vergleich zum Vorjahr verschlechtert, und das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf eine Verbesserung bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen im von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Emittenten zurückzuführen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das externe Rating verschlechtert. Die ESG-Analyse wird intern durchgeführt, mit Unterstützung durch die Daten externer Anbieter, und nicht ausgelagert. Der Sub-Investment-Manager nimmt auf kontinuierlicher Basis Bewertungen dieser ESG-Merkmale vor. Von Zeit zu Zeit kann es vorkommen, dass einem Emittent zum Zeitpunkt der Anlage für einen kurzen Zeitraum kein NB-ESG-Quotient-Rating zugewiesen wird Der Sub-Investment-Manager steht in regelmäßigen Abständen mit externen Anbietern von ESG-Daten in Kontakt, um Themen wie die Datenabdeckung zu diskutieren und Optionen zur Behebung von Datenlücken zu prüfen. Die Nutzung mehrerer externer Anbieter von ESG-Daten ermöglicht es dem Sub-Investment-Manager, die Datenabdeckung und die Qualität der Daten der externen Anbieter von ESG-Daten zu bewerten. Darüber hinaus prüft der Sub-Investment-Manager weiterhin neue ESG-Datenprodukte und externe Anbieter von ESG-Daten, um potenzielle Verbesserungen unserer bestehenden ESG-Datenabdeckung zu bewerten.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-10,2 %	33 %
Bezugszeitraum 2023	-8,7 %	20 %

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmensemittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios ist im Vergleich zum Vorjahr zurückgegangen. Zurückzuführen ist dies auf die Handelsaktivität und Datenbeschränkungen. Der CVaR wird nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmensemittenten angewandt und ist stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die es ausreichende und zuverlässige Daten gibt.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

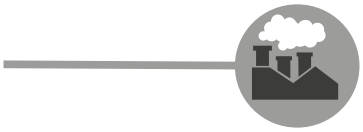
Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment- Manager berücksichtigte in Bezug auf die Nachhaltigkeitsfaktoren die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 1 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**"), und die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Teil 2 der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind, für staatliche Emittenten (die „**staatlichen PAIs**") (zusammen die „**PAIs auf Produktebene**"):

Teil 1 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)
Teil 2 – staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 - THG-Emissionsintensität
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
TREASURY (CPI) NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	3,0 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k.A.	1,9 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k.A.	1,7 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k.A.	1,6 %	USA
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,5 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k.A.	1,4 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k.A.	1,3 %	USA
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	USA
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,1 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k.A.	1,0 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k.A.	1,0 %	USA
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,0 %	USA
TREASURY NOTE	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,0 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k.A.	1,0 %	USA
UMBS 30YR TBA(REG A)	k.A.	1,0 %	USA

**O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

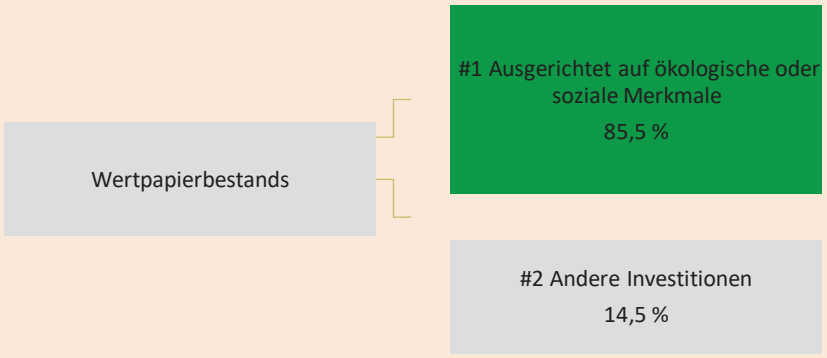
Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 60 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 85,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 40 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 14,5 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
A – Landwirtschaft, Forstwirtschaft und Fischerei	0,0 %
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,4 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,2 %
D – Energieversorgung	1,8 %
E – Wasserversorgung, Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,0 %
F – Baugewerbe/Bau	0,2 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,3 %
H - Verkehr und Lagerei	2,4 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,2 %
J – Information und Kommunikation	4,2 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	15,2 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,9 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,3 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,1 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	14,1 %
P – Erziehung und Unterricht	0,1 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,5 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,5 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,1 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,0 %
Keine	50,7 %

**O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

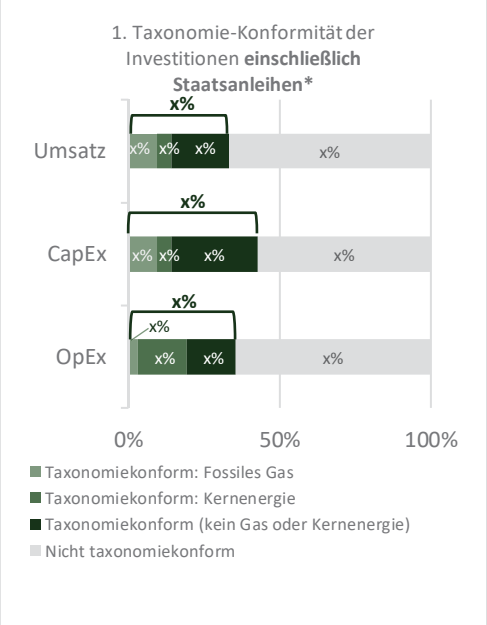
- ☐ Ja:
  - ☐ In fossiles Gas
  - ☐ In Kernenergie
- ☒ Nein

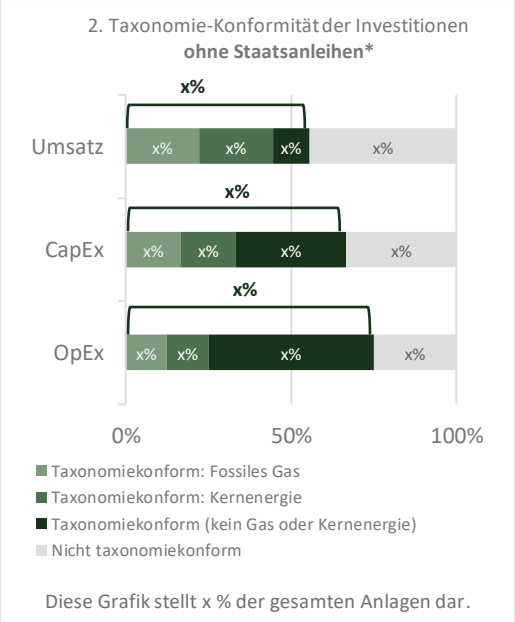
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate, Wertpapiere der Kategorie „To be Announced" [„**TBA**"] oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert sind, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen einzustufen waren.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

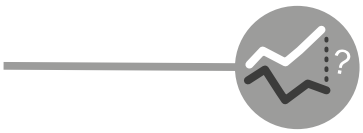
Durch die Integration der hausinternenen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Er strebte danach, konstruktiven Dialogen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Sustainable Asia High Yield Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 5493005FAT85HZ73DG37

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 63.2 %* an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „Bezugszeitraum“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio für Unternehmensemittenten beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO2-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen (**„THG"**) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

  n dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarb und bewirbt der Sub-Investment-Manager künftig die Verringerung des CO2-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-Treibhausgasemissionen.[1] Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

  Das Portfolio erreichte im Bezugszeitraum ein Niveau der reduzierten CO2-Emissionen, die um mindestens 30 % niedriger war als das des breiteren Anlageuniversum asiatischer Hochzinsanleihen, das durch den J.P. Morgan Asian Credit High Yield Index (der „**Index**") repräsentiert wird. Die durchschnittliche CO2-Emissionsintensität wurde auf der Grundlage der CO2-Emissionsintensität des Portfolios gemessen und berechnet. Sie wurde an jedem der vier Kalenderquartalsenden im Bezugszeitraum ermittelt. Das Portfolio wird aktiv verwaltet und beabsichtigte nicht, den Index abzubilden. Er wird hier zu Zwecken der Reduzierung der CO2-Emissionsintensität und des ESG-Vergleichs aufgenommen.

  Für den Bezugszeitraum erreichte das Portfolio eine höhere ESG-Bewertung als das breitere Universum asiatischer Hochzinsanleihen, das durch den Index repräsentiert wird, basierend auf den ESG-Bewertungen eines etablierten externen Anbieters.

- ***Soziale Merkmale:*** Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

[1]Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden.

   Der Sub-Investment-Manager schloss Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating aus, es sei denn, es bestand die begründete Erwartung, dass sich das NB-ESG-Quotient-Rating im Laufe der Zeit verbessern würde.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	56	**1-100**	**100 %**
Daten von Dritten	5,4	0-10	

   Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

   Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

   Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

   Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

   Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch

solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus wurden Emittenten ausgeschlossen, die direkt in Kinderarbeit und die Tabakindustrie involviert waren.

Ab dem 6. Dezember 2023 schloss das Portfolio Emittenten aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellten oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie hatten. Der Sub-Investment-Manager schloss außerdem Wertpapiere von Unternehmen aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielt haben.

Ab dem 6. Dezember 2023 investierte das Portfolio nicht in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente staatlicher oder zu 100 % in staatlichem Besitz befindlicher Emittenten, bei denen der Sub-Investment-Manager eine schwache ESG-Praxis festgestellt hat, und solche Emittenten wurden aus dem Portfolio ausgeschlossen. Diese Ausschlüsse basierten auf einer Reihe von ESG-Kriterien, darunter:

- Staatliche Emittenten, die auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten im untersten Dezil rangierten und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen bestanden; oder
- staatliche Emittenten, die aufgrund von ESG-Erwägungen aus dem J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index ausgeschlossen wurden; oder
- Staatliche Emittenten, deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat aufgrund von Menschenrechtsverletzungen mit Sanktionen belegt wurden; oder
- staatliche Emittenten, bei denen eine hohe und steigende Emissionsintensität bezogen auf die Treibhausgase festgestellt wurde; oder
- staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht einhielten, oder
- staatliche Emittenten, die von der Financial Task Force („**FATF**") als Hochrisikoland eingestuft wurden

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	Rating der Daten durch externe Anbieter	Kombinierte Abdeckung
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	55	4,2	95 %
Bezugszeitraum 2023	56	5,4	100 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das Rating externer Anbieter verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartige Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Sub-Investment-Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, hat der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten hat der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und

- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („**SDGs**“).

Die Berücksichtigung Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle

Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager hat auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit". Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

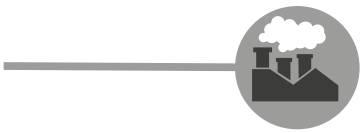
Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen

	PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

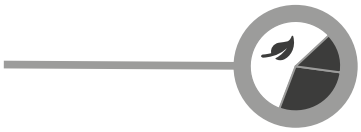
Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
GREENKO POWER II LIMITED RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	4,0 %	Indien
SANDS CHINA LTD	R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	3,5 %	Macau
STANDARD CHARTERED PLC RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,7 %	Hongkong
GLOBE TELECOM INC RegS	J – Information und Kommunikation	2,4 %	Philippinen
MELCO RESORTS FINANCE LTD RegS	R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	2,4 %	Macau
STUDIO CITY FINANCE LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,3 %	Macau
MELCO RESORTS FINANCE LTD RegS	R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	2,3 %	Macau
CONTINUUM ENERGY LEVANTER PTE LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,1 %	Indien
NETWORK I2I LTD RegS	J – Information und Kommunikation	2,1 %	Indien
WYNN MACAU LTD RegS	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,9 %	Macau
RENEW POWER PVT LTD RegS	D – Energieversorgung	1,8 %	Indien
JSW HYDRO ENERGY LTD RegS	D – Energieversorgung	1,8 %	Indien
ADANI GREEN ENERGY UP LTD RegS	D – Energieversorgung	1,7 %	Indien

STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG WIND RegS	D – Energieversorgung	1,7 %	Indonesien
SRI LANKA DEMOCRATIC SOCIALIST RE RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,7 %	Sri Lanka

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögens-werten an.

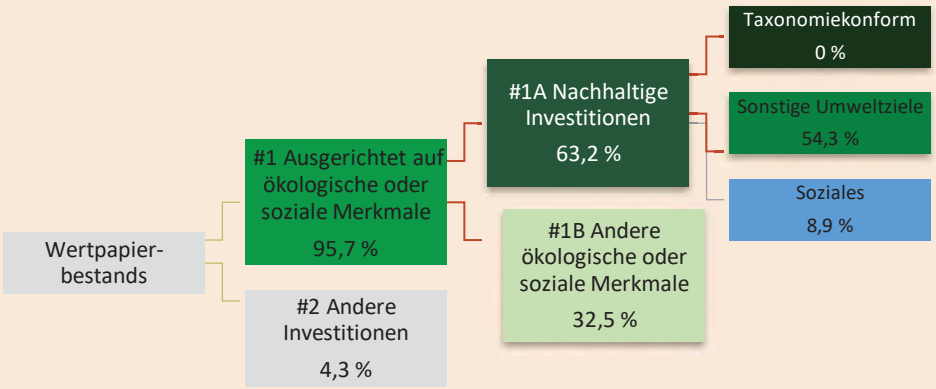
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 95,7 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio verpflichtete sich, mindestens 50 % nachhaltige Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums 2023 hielt das Portfolio 63,2 % an nachhaltigen Investitionen.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,3 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:
- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,9 %
D – Energieversorgung	10,2 %
F – Baugewerbe/Bau	5,5 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,9 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	5,0 %
J – Information und Kommunikation	4,7 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	50,9 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	1,4 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	6,3 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	9,2 %
Keine	1,0 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

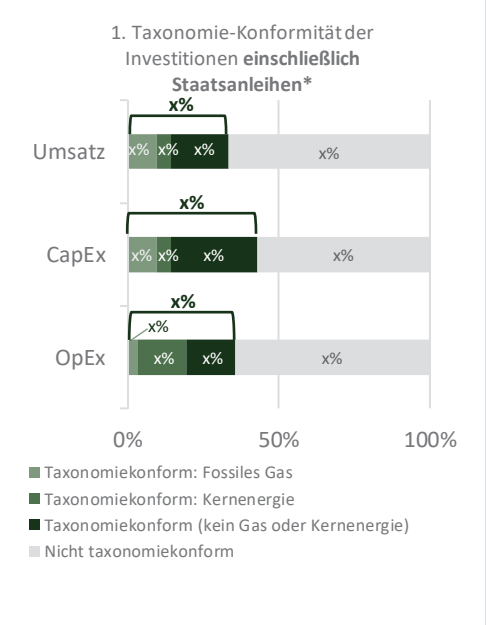
Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[2]?

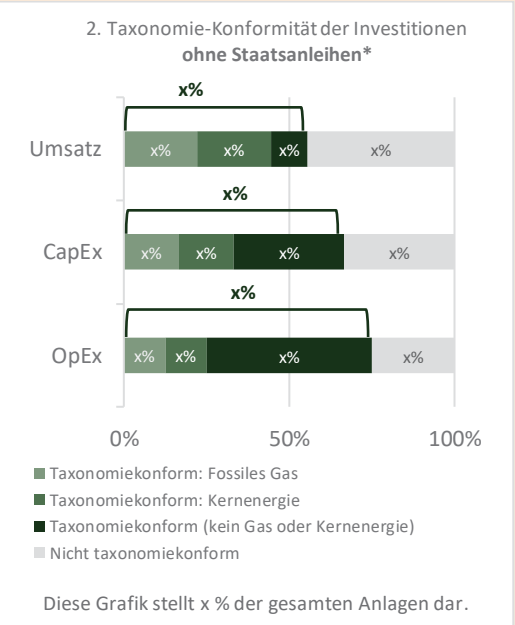
☐ Ja:

☐ In fossiles ☐ Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

[2] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 54,3 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 8,9 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine wichtige Komponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:
Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Corporate Debt Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300GFVSJXLSLRQ502

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 51,6 %* an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Weitere Einzelheiten zum Mindestanteil nachhaltiger Investitionen, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben, finden Sie unter der Frage „Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und Landnutzung, Kohlenstoffemissionen, Gelegenheiten für saubere Technologien, Wasserstress, Schadstoffemissionen und Abfälle, Finanzierung von Umweltauswirkungen, CO2-Fußabdruck von Produkten, Umweltpolitik, Umweltmanagementsystem, Programme zur Reduzierung von THG-Emissionen (**„THG“**) umweltfreundliche Beschaffungspolitik und Programme für treibhausfreie Luftemissionen.

  In dem Bestreben, das Portfolio auf ein Netto-Null-Ziel auszurichten, bewarben und bewerben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Verringerung des CO2-Fußabdrucks des Portfolios in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-THG-Emissionen.[1] Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf das Zwischenziel 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

  Das Portfolio erreichte eine CO2-Emissionsointensität, die mindestens 30 % unter derjenigen des breiteren Anlageuniversums für Unternehmensanleihen aus Schwellenländern lag, das durch den Index J.P. Morgan CEMBI Diversified (USD) Index (der „Index“) repräsentiert wird. Davon ausgenommen sind Wertpapiere, die von Nicht-Unternehmensemittenten begeben wurden, zu denen öffentliche oder quasi-öffentliche Emittenten (d. h. staatliche Emittenten) sowie Barmittel oder Barmitteläquivalente gehören („ausgeschlossene Wertpapiere“). Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Das Portfolio wurde aktiv verwaltet und bildete nicht den Index ab. Er wurde hier zu Vergleichszwecken für die Reduzierung der CO2-Emissionsintensität und von aufgenommen.

  Für den Bezugszeitraum erreichte das Portfolio eine höhere ESG-Bewertung (wie von einem dritten Datenanbieter zugewiesen) als das breitere, durch den Index repräsentierte Universum der Unternehmensanleihen aus Schwellenländern.

- ***Soziale Merkmale***: Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Schutz der Privatsphäre und Datensicherheit, Produktsicherheit und -qualität, Sicherheit von Finanzprodukten, Diskriminierungspolitik, Programme zur Einbindung der Gemeinschaft, Diversitätsprogramme und Menschenrechtspolitik.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses haben der Manager und der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**“) basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des

[1]Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühten sich der Manager und der Sub-Investment-Manager einem konstruktiven Dialog mit Emittenten mit einer schlechten Bewertung des NB-ESG-Quotienten Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	60	1-100	100 %
Daten von Dritten	5,6	0-10	

Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik::

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy und die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Das Portfolio baut sein Engagement in Kraftwerkskohle schrittweise ab und verbietet Investitionen in Wertpapiere von Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus dem Abbau von Kraftwerkskohle erzielten oder die neue Kohlekraftwerke ausbauten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Das Portfolio verbot außerdem Investitionen in Emittenten aus der Kraftwerksindustrie, die mehr als 95 % ihrer installierten Kraftwerkskapazitäten aus Kraftwerkskohle beziehen, die in neue Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle expandieren oder deren Investitionsbudgets für Expansionszwecke keine Mindestschwelle für Investitionen in Nicht-Kohle enthalten (wie durch interne Prüfungen festgestellt). Ab dem 6. Dezember 2023 schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellen oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie hatten. Das Portfolio hat Wertpapiere von Unternehmen ausgeschlossen, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung erzielt haben. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem

unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Darüber hinaus schloss das Portfolio Wertpapiere von Emittenten aus, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Tabakerzeugnissen oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielten. Emittenten, die an direkter Kinderarbeit beteiligt waren, und Emittenten, die mehr als 10 % der Umsätze aus der Ölsandgewinnung erzielten, wurden ebenfalls ausgeschlossen.

Ab dem 6. Dezember 2023 investierte das Portfolio nicht in Schuldtitel und Geldmarktinstrumente staatlicher oder zu 100 % in staatlichem Besitz befindlicher Emittenten, bei denen der Manager und der Sub-Investment-Manager eine schwache ESG-Praxis festgestellt haben, und solche Emittenten wurden aus dem Portfolio ausgeschlossen. Diese Ausschlüsse basierten auf einer Reihe von ESG-Kriterien, darunter:

- Staatliche Emittenten, die auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten im untersten Dezil rangierten und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen bestanden; oder
- Staatliche Emittenten, die aufgrund von ESG-Erwägungen aus dem J.P. Morgan ESG EMBI Global Diversified Index ausgeschlossen wurden; oder
- Staatliche Emittenten, deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat aufgrund von Menschenrechtsverletzungen mit Sanktionen belegt wurden; oder
- Staatliche Emittenten, bei denen eine hohe und steigende Emissionsintensität bezogen auf die Treibhausgase festgestellt wurde; oder
- Staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht einhielten, oder staatliche Emittenten, die von der Financial Action Task Force („**FATF**") als Hochrisikoland eingestuft wurden.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio haben der Manager und der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich haben der Manager und der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise ihrer Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager erörterten und diskutierten die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund ihres eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	59	5,5	98 %

Bezugszeitraum 2023	60	5,6	100 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es kein nachhaltiges Anlageziel. Das Portfolio hielt jedoch nachhaltige Investitionen, die die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale bewarben.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckt sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Investition zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Investition eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartige Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die wirtschaftlichen Tätigkeiten eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmalen ausgerichtet waren.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager überprüften die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten diese Prüfung bestanden haben, haben der Manager und der Sub-Investment-Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag des Emittenten zur Wirtschaft gemessen.

Bei Unternehmensemittenten haben der Manager und der Sub-Investment-Manager dies auf zwei Arten erfasst:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („**SDGs**“).

Die Berücksichtigung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs, nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers, war durch die Verfügbarkeit von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griffen der Manager und der Sub-Investment-Manager auf Daten von Drittanbietern und Stellvertreterdaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wandten ihren Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachteten der Manager und der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben auch Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen berücksichtigt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit“. Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager und den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine

erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden, unterschreiten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager investierten nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager und den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

I. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

II. Der Manager und der Sub-Investment-Manager berücksichtigten die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers und des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager und der Sub-Investment-Manager nutzten Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager und den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Manager und dem Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und

- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager und der Sub-Investment-Manager haben die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ROMANIA (REPUBLIC OF) MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,4 %	Rumänien
COTE D IVOIRE (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,2 %	Elfenbeinküste
SANDS CHINA LTD	R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,0 %	Macau
WYNN MACAU LTD RegS	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,9 %	Macau
TSMC ARIZONA CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,9 %	Taiwan (Republik China)
TSMC GLOBAL LTD RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,9 %	Taiwan (Republik China)
MELCO RESORTS FINANCE LTD RegS	R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,8 %	Macau
KOSMOS ENERGY LTD RegS	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,7 %	Ghana
BOC AVIATION LTD MTN RegS	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	0,7 %	Singapur
ECOPETROL SA	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	0,6 %	Kolumbien
BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD (HONG K MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	Thailand
THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD MTN RegS	M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,6 %	Thailand
CENCOSUD SA RegS	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,6 %	Chile
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	Türkei
HUARONG FINANCE II CO LTD MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,6 %	China

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

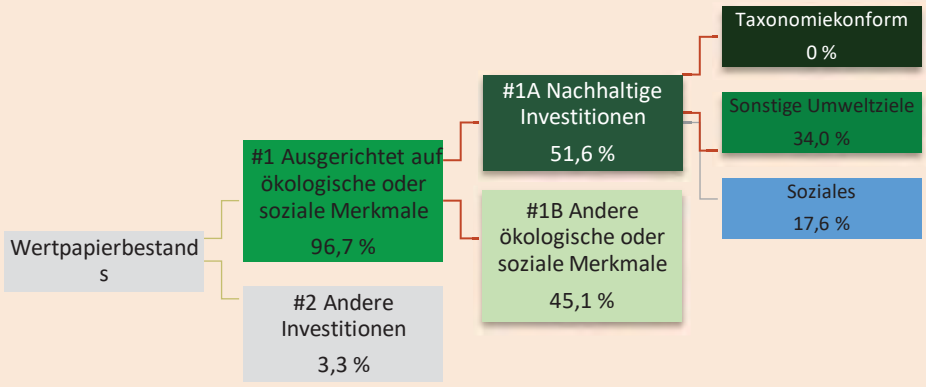
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,7 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio verpflichtete sich, mindestens 50 % nachhaltige Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums 2023 hielt das Portfolio 51,6 % an nachhaltigen Investitionen.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,3 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager berechneten den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager und der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatten. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige** Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.

– Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	10,1 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	13,2 %
D – Energieversorgung	2,7 %
F – Baugewerbe/Bau	0,9 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,3 %
H - Verkehr und Lagerei	1,8 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,4 %

J – Information und Kommunikation	4,6 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	51,8 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,6 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,7 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,6 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	5,7 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	2,9 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,2 %
Keine	0,4 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: *Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[2]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

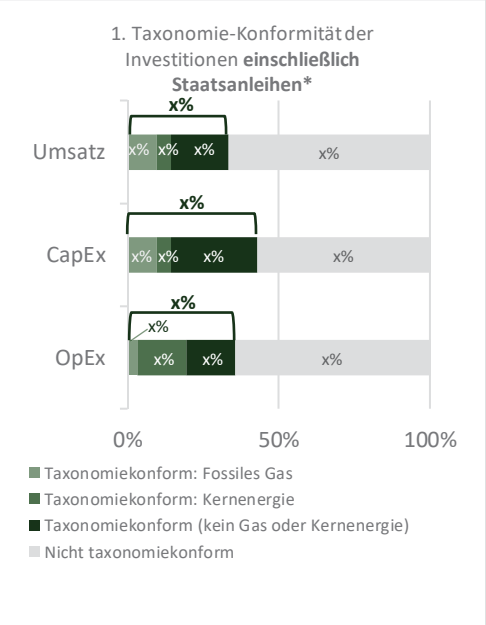
☒ Nein

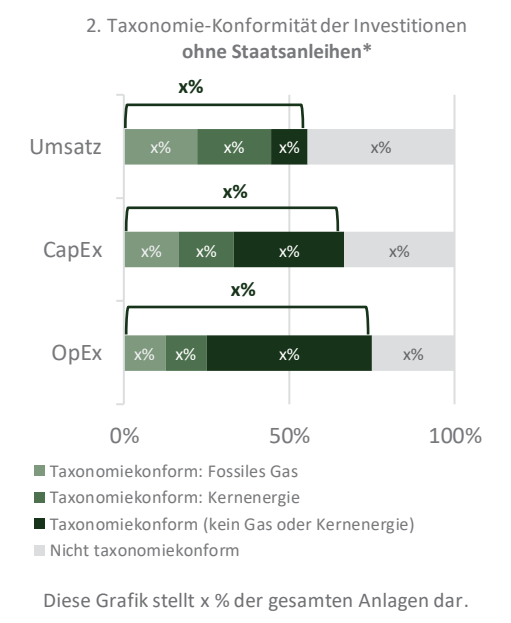
[2] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Weder der Manager noch der Sub-Investment-Manager können bestätigen, dass das Portfolio in Investitionen investiert hat, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager und der Sub-Investment-Manager werden das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessert.

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio hielt 34,0 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 17,6 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager und der Sub-Investment-Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachteten, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen, verhinderten und sie sicherstellen, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager wendeten bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager verstehen unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Managers und des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager und der Sub-Investment-Manager sind der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers und des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager und vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager und der Sub-Investment-Manager engagierten sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager und der Sub-Investment-Manager betrachteten diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil ihres Anlageprozesses. Die Fortschritte bei der Einbindung wurden vom Manager und dem Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9, Absätze 1 bis 4a, der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten.

Name des Produkts: Neuberger Berman Sustainable Emerging Market Debt – Hard Currency Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300OWRIKGBWGY0X93

Nachhaltiges Investitionsziel

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ **Ja**

☐ **Nein**

☒ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: **56,9 %**

- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☒ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: **36,9 %**

☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.

- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel

☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Das Portfolio investierte in Wertpapiere von Emittenten, die zu ökologischen und sozialen Zielen beitrugen. Die Emittenten wurden gegenüber dem nachhaltigen Anlageziel anhand der nachstehend aufgeführten Parameter bewertet.

Ökologische Ziele

Der Sub-Investment-Manager hat gezielt in Emittenten investiert, die nachweislich bessere einkommensbereinigte Fortschritte bei der Anpassung und der Eindämmung des Klimawandels, der Reduzierung von Treibhausgasemissionen („THG"), der Vitalität von Ökosystemen und der Ausrichtung auf das Netto-Null-Ziel gemacht haben.

Ziele staatlicher Emittenten:

Länder, die sich im obersten 25. Perzentil befinden oder im nächsten 25. Perzentil mit sich verbessernden Merkmalen in Bezug auf den Indikator des staatlichen Klimaübergangsrisiko (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers und kombiniert Daten, die sich auf die Minderung des Klimarisikos, die Anpassung an den Klimawandel, die Vitalität von Ökosystemen, die THG-Emissionen und die Anpassung an das Netto-Null-Ziel konzentrieren), wurden als in Einklang mit dem Umweltziel erachtet.

Die Netto-Null-Verpflichtungen und -Ziele wurden in der Erwartung festgelegt, dass die Regierungen ihre eigenen Verpflichtungen einhalten, um sicherzustellen, dass die Ziele des Pariser Abkommens erreicht werden, einschließlich erhöhter Ambitionen ihrer national festgelegten Beiträge (Nationally Determined Contributions, „**NDCs"**).

Ziele unternehmerischer Emittenten:

Der Sub-Investment-Manager beabsichtigt, den CO2-Fußabdruck des Portfolios für Wertpapiere von Unternehmen in Bezug auf Scope-1-, Scope-2- und wesentliche Scope-3-THG-Emissionen zu reduzieren, was einer Verringerung um 50 % bis 2030 im Vergleich zu einem als Basiswert angenommenen Jahr (2019) und einen anschließenden Rückgang auf Null netto bis 2050 entspricht. Das Basisjahr 2019 kann neu berechnet werden, wenn sich die Datenqualität und die Offenlegung im Laufe der Zeit verbessern, insbesondere in Bezug auf die Scope-3-Emissionen.[1] Es existiert kein jährliches Reduktionsziel. Stattdessen wird sich auf den Meilenstein 2030 und das Netto-Null-Ziel 2050 konzentriert.

Soziale Ziele

Der Sub-Investment-Manager zielte auf Investitionen in Emittenten ab, die bessere einkommensbereinigte Fortschritte bei der Erreichung der UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**"), mit einem Schwerpunkt auf den Bereichen öffentliche Gesundheit und Bildung, nachweisen konnten.

Länder, die sich im obersten 25. Perzentil befinden oder im nächsten 25. Perzentil mit sich verbessernden Merkmalen in Bezug auf den Indikator für staatliche Nachhaltigkeit (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers und kombiniert Daten, die sich auf Lebenserwartung, Zugang zu Impfungen und medizinischem Fachpersonal, Sekundarschulbildung und eine geringere Einkommensgleichheit), wurden als in Einklang mit dem sozialen Ziel erachtet.

Das Portfolio hat sein nachhaltiges Anlageziel erreicht. Die Performance bzgl. des nachhaltigen Anlageziels wurde anhand der Nachhaltigkeitsindikatoren gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

[1]Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus Quellen, die sich im Besitz des Emittenten befinden oder von ihm kontrolliert werden (z. B. Emissionen, die sich direkt durch die Geschäftsprozesse des Emittenten oder durch Fahrzeuge im Besitz des Emittenten ergaben). Scope-2-Emissionen sind indirekte Emissionen aus der Erzeugung von Strom, Dampf, Wärme und Kälte, die vom Emittenten verbraucht wurden. Scope-3-Emissionen sind alle anderen indirekten Emissionen, die in der Wertschöpfungskette eines Emittenten anfallen (u. a. Emissionen aus den vom Emittenten verbrauchten Produkten oder Dienstleistungen, aus der Entsorgung seiner Abfälle, aus dem Pendelverkehr seiner Mitarbeiter, aus dem Vertrieb und Transport seiner Produkte oder aus seinen Investitionen).

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanz-produkts erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die Erreichung der nachhaltigen Anlageziele des Portfolios zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

i. Berichte und Bewertungen von unabhängigen Dritten:

Der Sub-Investment-Manager nutzte die folgenden Berichte, Indizes und Bewertungen von Dritten, um die Fortschritte des Portfolios bei der Erreichung seiner nachhaltigen Anlageziele für Staaten zu messen:

Fortschritte im Hinblick auf die UN-Ziele für nachhaltige Entwicklung mit einem Schwerpunkt auf die Anpassung an den Klimawandel und den Klimaschutz:

- Notre Dame Global Adaptation Initiative Country Index („**ND-GAIN“**)

Der Sub-Investment-Manager verwendete den ND-GAIN-Index, um die Anfälligkeit eines Landes für den Klimawandel und die Klimaübergangsrisiken zu messen und zu bewerten.

Der Sub-Investment-Manager konzentrierte sich bei seiner Bewertung auf die einkommensbereinigte Anpassung an den Klimawandel.

- THG-Emissionen von Staaten:

Der Sub-Investment-Manager verfolgte die territorialen THG-Emissionen von Staaten, definiert als Tonnen CO2-Emissionen des um die Kaufkraft („**PPP**“) bereinigten BIP (territoriale Produktionsemissionen) oder pro Kopf (territoriale Konsumemissionen). Emittenten mit der höchsten territorialen Produktionsemissionen – definiert als oberstes Quartil und zunehmend – wurden aus dem Portfolio ausgeschlossen.

- Environmental Performance Index

Der Sub-Investment Manager verfolgte einkommensbereinigte Daten zur Vitalität von Ökosystemen aus dem Environmental Performance Index, einem gemeinsamen Projekt des Yale Center for Environmental Law & Policy und des Center for International Earth Science Information Network („**CIESIN**“) am Earth Institute der Columbia University. Dieser Indikator erfasste, wie gut die Länder Ökosysteme und die von ihnen erbrachten Leistungen erhalten, schützen und verbessern. Er besteht aus sechs Emissionskategorien: Biodiversität und Lebensräume, Ökosystemdienstleistungen, Fischereien, saurer Regen, Landwirtschaft und Wasserressourcen.

- Anpassung an das Netto-Null-Ziel – GermanWatch's Climate Change Performance Index („**CCPI“**) und Climate Action Tracker

Der Sub-Investment-Manager verfolgte die Anpassung an das Netto-Null-Ziel von Ländern, die Staatsanleihen begeben gemäß dem CCPI und dem vom Climate Action Tracker gemessenen nationalen und globalen Bemühungen zur Eindämmung der globalen Erwärmung. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, Länder anzuvisieren, die sich bis 2050 oder früher zu Netto-Null-Emissionen verpflichtet haben.

Fortschritte bei den UN-Zielen für nachhaltige Entwicklung, mit Schwerpunkt auf der öffentlichen Gesundheit, der Sekundarschulbildung und der Überwindung von Einkommensungleichheiten:

- Sustainable Development Report Index

Der Sub-Investment-Manager nutzte die Bertelsmann Stiftung und den Sustainable Development Solutions Network Sustainable Development Report Index, um die Leistung von Ländern bzgl. der SDGs zu bewerten. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, gezielt in Emittenten zu investieren, die bessere Fortschritte bei der Verwirklichung der SDGs demonstrierten. Länder, welche die ökologischen oder sozialen Ziele erfüllen, müssen ferner im obersten 75. Perzentil des Sustainable Development Report Index platziert sein, um als nachhaltig zu gelten.

- UNDP Human Development Index

Der Sub-Investment-Manager nutzte den UNDP-Index für menschliche Entwicklung, um auf einkommensbereinigter Basis die Errungenschaften in den Schlüsselbereichen Lebenserwartung, Bildung und Einkommensgleichheit weltweit zu messen. Dies ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, gezielt in Emittenten zu investieren, die bessere Fortschritte für die menschliche Entwicklung demonstrierten.

- Weltgesundheitsorganisation (WHO) – Das Globale Gesundheitsobservatorium

Der Sub-Investment-Manager setzte einkommensbereinigte Daten des Globalen Gesundheitsobservatoriums über die Durchimpfungsrate (Diphtherie-Tetanus-Toxoid) und Keuchhusten („**DTP3**“) bei Einjährigen sowie die Zahl der Ärzte pro Kopf der Bevölkerung ein.

Top-Performer oder Top-Improver im Portfolio

Die oben aufgeführten Berichte und Bewertungen unabhängiger Dritter wurden zusammengefasst, um „Top-Performers“ (Länder im obersten 25. Perzentil, die mit den ökologischen und/oder sozialen Zielen des Portfolios übereinstimmten) oder „Top-Improvers“ (Länder im nächsthöheren 25. Perzentil, die sich verbessern und an die staatlichen ökologischen und/oder sozialen Zielen des Portfolios angepasst waren und weiterhin anpassen) zu identifizieren.

Nur staatliche Emittenten aus Schwellenländern, die den ökologischen und/oder sozialen Ziele des Portfolios entsprachen und als Top-Performer oder Top-Improver eingestuft wurden, wurden vom Portfolio gehalten. Die Einstufung von Ländern als Top-Performer oder Top-Improver ist ein Hinweis darauf, dass das Portfolio seine Umwelt- und sozialen Ziele erfüllt.

ii. ESG-Ausschlüsse:

Zur Sicherstellung, dass die nachhaltigen Anlageziele des Portfolios erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy, die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy, die Neuberger Berman Sustainable Exclusion Policy oder die Neuberger Berman Enhanced Sustainable Exclusion Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren).

Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Ab dem 6. Dezember 2023 schloss das Portfolio Unternehmen aus dem Anlageuniversum aus, die Brandwaffen unter Verwendung von weißem Phosphor herstellten oder einen Bezug zur Atomwaffenindustrie hatten. Das Portfolio hat ferner Wertpapiere von Unternehmen ausgeschlossen, die 5 % oder mehr ihrer Umsätze aus der Herstellung von Material für die Erwachsenenunterhaltung oder der Herstellung konventioneller Waffen erzielt haben.

Das Portfolio investierte nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen werden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**“), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**“), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**“) und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**“) verstießen.

Außerdem schoss der Sub-Investment-Manager Wertpapiere von Unternehmensemittenten aus dem Anlageuniversum aus, die hinsichtlich des NB-ESG-Quotienten[2] am schlechtesten bewertet wurden.

Darüber hinaus schloss der Sub-Investment-Manager staatliche Emittenten aus, deren Menschenrechtslage sich verschlechtert hat und deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat wegen Menschenrechtsverletzungen sanktioniert wurden, oder andere staatliche Emittenten, deren THG-Intensität als hoch erachtet wird und zunimmt, oder staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht eingehalten haben, oder staatliche Emittenten, die von der Financial Action Task Force („FATF“) als Hochrisikoland eingestuft wurden.

[2]Der NB- ESG-Quotient ist ein hausinternes ESG-Ratingsystem von NB, das auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten basiert und ein ESG-Gesamtrating für Emittenten erstellt, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

Mindestens 20 % des Anlageuniversums wurden aus diesen Gründen ausgeschlossen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

i. Berichte und Bewertungen von unabhängigen Dritten

Im Bezugszeitraum kam es zu den folgenden bemerkenswerten Änderungen gegenüber dem vorherigen Bezugszeitraum:

- Zwei weitere Länder wurden dank Fortschritten bei der Netto-Null-Ausrichtung als ökologisch nachhaltig eingestuft;
- drei weitere Länder wurden dank Fortschritten in Bezug auf die einkommensbereinigte Anpassung an den Klimawandel und die Einführung der Kennzahl zur wirtschaftlichen Vitalität als ökologisch nachhaltig eingestuft;
- vier Länder wurden aufgrund einer schwachen einkommensbereinigten Vitalität von Ökosystemen nicht mehr länger als ökologisch nachhaltig eingestuft;
- ein Land wurde aufgrund einer Verschlechterung bei der einkommensbereinigten Anpassung an den Klimawandel und der THG-Emissionsintensität nicht mehr länger als ökologisch nachhaltig eingestuft;
- zwei weitere Länder wurden dank Einkommensanpassung und neuer Kennzahlen zur Gesundheit und Einkommensungleichheit als sozial nachhaltig eingestuft;
- ein weiteres Land wurde dank Einkommensanpassung und neuer Kennzahlen zur Gesundheit als sozial nachhaltig eingestuft;
- ein weiteres Land wurde dank einer niedrigeren THG-Emissionsintensität als sozial nachhaltig eingestuft;
- zwei Länder wurden aufgrund von Einkommensanpassung und neuer Kennzahlen zur Gesundheit und Einkommensungleichheit nicht mehr länger als sozial nachhaltig eingestuft;
- ein Land wurde aufgrund neuer Kennzahlen zur Gesundheit und Einkommensungleichheit nicht mehr länger als sozial nachhaltig eingestuft;
- ein Land wurde aufgrund der Kennzahl für die Einkommensungleichheit nicht mehr länger als sozial nachhaltig eingestuft; und
- zwei weitere Länder wurden aufgrund von hohen und sich verschlechternden THG-Emissionen nicht mehr länger als ökologisch oder sozial nachhaltig eingestuft.

ii. ESG-Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Der Sub-Investment-Manager wandte seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigten. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachen würde, betrachtete der Sub-Investment-Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Sub-Investment-Manager trug bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele waren, den folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen Rechnung. Bei staatlichen Emittenten (die den Großteil des Portfolios ausmachten) werden diese im Detail im ersten Abschnitt der nachstehenden Tabelle („**Staatliche PAIs**“) und bei Unternehmensemittenten (die „**PAIs für Unternehmensemittenten**“) im zweiten Abschnitt aufgeführt (zusammen die „**PAIs**“):

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Teil 1 – Staatliche PAIs	
Umwelt	PAI 15 – THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird
Soziales	PAI 16 - Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen
Teil 2 – PAIs für Unternehmensemittenten	
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung von Emittenten, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für die relevanten PAIs festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für die relevanten PAIs festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben aufgeführten detaillierten NB-ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Sub-Investment-Manager investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy identifiziert werden.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Sub-Investment-Manager prüfte die Auswirkungen der PAIs auf Nachhaltigkeitsfaktoren.

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

In Bezug auf das Portfolio erfolgte die Betrachtung der PAIs durch den Sub-Investment-Manager durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die quantitative und qualitative Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für die relevante PAI festgelegt wurden, unterschritten;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben aufgeführten detaillierten NB-ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln. Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

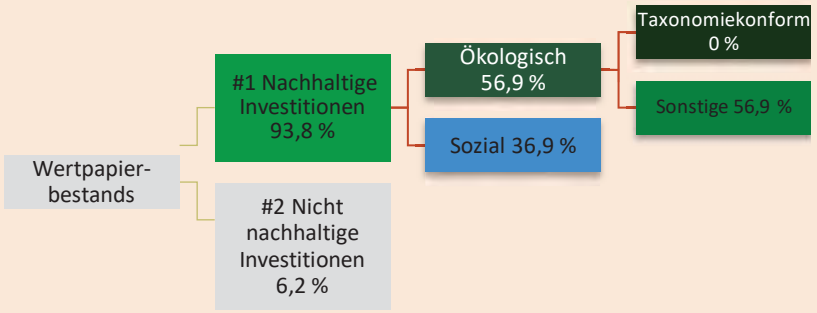
Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
OMAN GOVERNMENT BOND MTN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,9 %	Oman
CHILE (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,9 %	Chile
ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,7 %	Argentinien
ROMANIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,5 %	Rumänien
REPUBLIC OF PERU	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,5 %	Peru
DOMINICAN REPUBLIC (GOVERNMENT) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,3 %	Dominikanische Republik
REPUBLIC OF ARMENIA RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,2 %	Armenien
MEXICO (UNITED MEXICAN STATES)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,1 %	Mexiko
SERBIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,0 %	Republik Serbien
BRAZIL FEDERATIVE REPUBLIC OF (GOV	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	2,0 %	Brasilien
MOROCCO (KINGDOM OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,9 %	Marokko
COSTA RICA REPUBLIC OF (GOVERNMEN RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,7 %	Costa Rica
MOROCCO KINGDOM OF (GOVERNMENT) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,7 %	Marokko
COLOMBIA (REPUBLIC OF)	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,7 %	Kolumbien
SERBIA (REPUBLIC OF) RegS	O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	1,6 %	Republik Serbien

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung können sein: Barclays Industry, Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



#1 Nachhaltige Investitionen umfasst nachhaltige Investitionen mit ökologischen oder sozialen Zielen.

#2 Nicht nachhaltige Investitionen umfasst Investitionen, die nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Das Portfolio ist bestrebt, mindestens 80 % an nachhaltigen Investitionen zu halten. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 93,8 % an nachhaltigen Investitionen.

Das Portfolio zielt darauf ab, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht nachhaltig sind und unter die Kategorie „Nicht Nachhaltig“ des Portfolios fallen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 6,2 % an Investitionen der Kategorie „Nicht Nachhaltig“.

Die Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder Dritten beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Taxonomie-konforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,2 %
H - Verkehr und Lagerei	1,1 %
J – Information und Kommunikation	0,1 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,6 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	90,7 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,9 %
Keine	1,5 %

*O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung können sein: Barclays Industry, Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[3]?

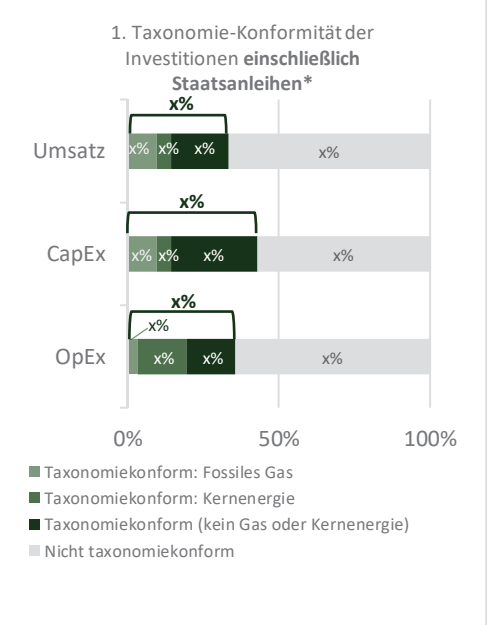
☐ Ja:

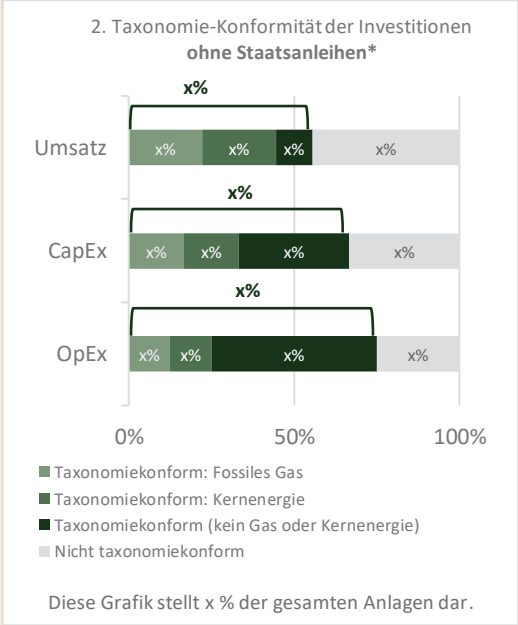
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

[3] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

sind ökologisch nachhaltige Investitionen, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Das Portfolio hielt 56,9 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio hielt 36,9 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fallen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Nicht Nachhaltig“ umfasste die verbleibenden Anlagen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die sich nicht als nachhaltige Investitionen qualifizierten.

Die Investitionen der Kategorie „Nicht Nachhaltig“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Sub-Investment-Manager als notwendig für das ordnungsgemäße Funktionieren des Portfolios erachtete, z. B. die Gewährleistung einer angemessenen Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager war der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine nachhaltigen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem nachhaltigen Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

i. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager verstand unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigte daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit dem Nachhaltigkeitsziel des Portfolios, indem es (wie jeweils anwendbar) Berichte und Bewertungen von unabhängigen Dritten, den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete.

Der Indikator für die Entwicklung der Nachhaltigkeit von Staaten (dieser Indikator ist Eigentum des Sub-Investment-Managers) bewertete die Fortschritte staatlicher Emittenten bei der Anpassung an den Klimawandel und dem Klimaschutz, der Verringerung der THG-Emissionen und der Ausrichtung auf Netto-Null sowie bei der Erreichung der SDGs mit besonderem Schwerpunkt auf der öffentlichen Gesundheit und Bildung.

Der Sub-Investment-Manager führte zudem eine fortlaufende Analyse der ESG-Faktoren durch, indem er emittentenbezogene Bewertungen des NB-ESG-Quotienten erstellte und nutzte, um Risiken und Chancen bei der Gesamtbewertung der Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings konnten auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Sub-Investment-Manager überwacht wurde.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der nachhaltigen Anlageziele des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

Emittenten mit einem günstigen NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn der Emittent keine diesbezüglichen Maßnahmen ergriffen hat, wurden nicht in das Portfolio aufgenommen.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	53	1-100	98 %
Daten von Dritten	4,3	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für den NB-ESG-Quotient wird ein Rating zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 das niedrigste und 100 das höchste Rating darstellt. Für dieses Portfolio gibt es keine Mindestrating des NB ESG-Quotienten. Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung des nachhaltigen Anlageziels. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertung der Daten Dritter reichen von 0–10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Der Sub-Investment-Manager tätigte keine Investitionen in staatlichen Emittenten, bei denen er eine schwache ESG-Praxis festgestellt hat. Diese Ausschlüsse basierten auf einer Reihe von ESG-Kriterien, darunter:

- Staatliche Emittenten, die auf der Grundlage des NB-ESG-Quotienten im untersten Dezil rangierten und bei denen keine Aussicht auf kurzfristige Verbesserungen bestanden;
- Staatliche Emittenten, die aufgrund von ESG-Erwägungen aus dem Referenzwert ausgeschlossen wurden; oder
- Staatliche Emittenten, deren führende Vertreter vom UN-Sicherheitsrat aufgrund von Menschenrechtsverletzungen mit Sanktionen belegt wurden; oder
- Staatliche Emittenten, bei denen eine hohe und steigende THG-Emissionsintensität festgestellt wurde; oder
- Staatliche Emittenten, bei denen schlechte und sich verschlechternde Kennzahlen für Menschenrechte und Rechtsstaatlichkeit festgestellt wurden; und
- staatliche Emittenten, die den vom Global Forum on Transparency and Exchange of Information for Tax Purposes der OECD aufgestellten Standard nicht einhielten, oder staatliche Emittenten, die von der FATF als Hochrisikoland eingestuft wurden.

ii. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

iii. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass das vom Portfolio beworbene nachhaltige Anlageziel erreicht wurde, wendete das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman Ultra Short Term Euro Bond Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 5493005BLB45DI1FOM10

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☒ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 16,6 %* an nachhaltigen Investitionen**
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☒ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

*Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 5 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Die Zahlen zu den nachhaltigen Investitionen sind, bedingt durch die uneinheitlichen Bezugszeiträume, nicht in der Tabelle zur Vermögensallokation enthalten.

**Weitere Einzelheiten zur Vermögensallokation des Portfolios (einschließlich des Engagements in nachhaltigen Investitionen) finden Sie nachfolgend unter der Frage „*Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?*“.

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken,

das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Biodiversität und verantwortliche Landnutzung, Verringerung des CO2-Fußabdrucks, Umweltmanagement, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Gelegenheiten für grüne Gebäude, Gelegenheiten für erneuerbare Energien, verantwortliche Rohstoffbeschaffung, verantwortliche und transparente Risikoübernahme, Schadstoffemissionen und Abfälle, Abfallentsorgung und Wasserbewirtschaftung.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzen, Zugang zu Arzneimitteln, Erschwinglichkeit und faire Preisgestaltung, Geschäftsethik und Transparenz in den Beziehungen zu Regierungen, Chemikaliensicherheit, Beziehungen in der Gemeinschaft, umstrittene Beschaffung, Unternehmensverhalten, Arzneimittelsicherheit und Nebenwirkungsmanagement, ethisches Marketing und ethische Praktiken, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit am Arbeitsplatz, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Datenschutz und -sicherheit, Produktsicherheit und -qualität sowie Rechtsstreitigkeiten und damit verbundene Kontroversen.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Obwohl die vom Portfolio gehaltenen nachhaltigen Investitionen entweder ein soziales oder ein ökologisches Ziel verfolgten, gelten solche nachhaltigen Investitionen nicht als ökologisch nachhaltige Investitionen (oder mit der Taxonomie in Einklang stehende Anlagen) im Sinne der EU-Taxonomie.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigte der Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergriffen hat, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	63	1-100	90 %
Daten von Dritten	6,8	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet. Für das NB-ESG-Quotient-Rating wird ein Wert zwischen 1 und 100 verwendet, wobei 1 die niedrigste und 100 die höchste Bewertung darstellt. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums wurde mit Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und Chancen des Übergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmensemittenten gemessen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts einer Emission oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und Chancen durch den Klimawandel pro Emisssion und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit eine Emission durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 5,3 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch die Zusammenarbeit mit den Emittenten zu adressieren.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Emittenten angewandt und stattdessen auf diejenigen Emittenten beschränkt, für die der Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 52 %, was einem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden entspricht.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Zur Sicherstellung, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als ein Verstoß gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Wertpapieren von Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Wertpapiere von Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischem Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Ferner durften für das Portfolio keine Wertpapiere von Emittenten gekauft werden, die an der Herstellung von Tabakprodukten wie Zigarren, Zigaretten, E-Zigaretten, rauchfreiem Tabak, auflösbarem Tabak und Kautabak beteiligt waren. Dies schloss auch Emittenten ein, die Rohtabakblätter anbauen oder verarbeiten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. Der NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	1-100	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	62	6,5	87 %
Bezugszeitraum 2023	63	6,8	90 %

Die Bewertung des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

Das Rating der Daten durch externe Anbieter hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf Verbesserungen bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Emittenten und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf potenzielle Änderungen oder Unterschiede im externen Emittenten-Rating.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-5,3 %	52 %
Bezugszeitraum 2023	-5,3 %	52 %

Die CVaR-Prognose ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

Obwohl das Portfolio ökologische und soziale Merkmale bewarb, hatte es während des Bezugszeitraums kein nachhaltiges Anlageziel. Seit dem 2. August 2023 hat sich das Portfolio dazu verpflichtet, mindestens 5 % nachhaltige Investitionen zu halten. Die nachhaltigen Investitionen bewarben die oben genannten ökologischen und sozialen Merkmale.

Die Einstufung der Investitionen des Portfolios als nachhaltig wurde unter Bezugnahme auf den nachhaltigen Anlagerahmen von NB festgelegt. Dieser Rahmen erstreckte sich auf eine Bewertung dahingehend (i) ob die Anlage zu einem Umwelt- und/oder sozialen Ziel beiträgt, (ii) ob die Anlage eine erhebliche Beeinträchtigung von derlei Zielen zur Folge hat (wie nachstehend erläutert) und (iii) auf eine Beurteilung der Gesamtbewertung im Hinblick auf die gute Unternehmensführung eines Emittenten, um festzustellen, ob der Emittent einer derartigen Beurteilung standhält.

Innerhalb dieses nachhaltigen Anlagerahmens griff der Manager auf mehrere Datenpunkte zurück, mit denen gemessen wurde, wie sehr die Wirtschaftstätigkeit eines Emittenten auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet war.

Der Manager überprüfte die Emittenten auf Kontroversen, erhebliche Beeinträchtigungen und Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen. Wenn die Emittenten dieser Prüfung standhielten, quantifizierte der Manager anschließend den ökologischen oder sozialen Beitrag der Emittenten zur Wirtschaft.

Der Manager erfasste dies auf zwei Arten:

- Ausrichtung der Umsätze auf die EU-Taxonomie (falls vorhanden) und
- Ausrichtung der Umsätze auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („**SDGs**“).

Die Beurteilung der Ausrichtung der Umsätze auf die SDGs wurde durch die Verfügbarkeit von angemessenen, verfügbaren und überprüfbaren Daten eingeschränkt. Um Fälle mit einer unzureichenden Datenlage abzumildern, griff der Manager auf Daten von Drittanbietern und Proxydaten sowie auf internes Research und qualitative Analysen als Bestandteil des nachhaltigen Anlagerahmens von NB zurück.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Ab dem 2. August 2023 wendet der Manager seinen Rahmen für nachhaltige Investitionen an, der darauf abzielt, Anlagen zu identifizieren und auszuschließen, die die ökologischen oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigen. Um festzustellen, ob eine Investition eine erhebliche Beeinträchtigung verursachte, betrachtete der Manager die erhebliche Beeinträchtigung unter Bezugnahme auf Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen und auf Verstöße gegen ein Mindestmaß an Schutzmaßnahmen.

Der Manager berücksichtigten bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele waren, die folgenden Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (die „**PAIs**“), die in der nachstehenden Tabelle aufgeführt sind:

PAIs	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind PAI 5 -Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen PAI 6 - Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren
Biodiversität	PAI 7 - Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken
Wasser	PAI 8 - Emissionen in Wasser
Abfall	PAI 9 - Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 11 - Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen PAI 12 - Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs zu berücksichtigen.

Der Manager berücksichtigte ferner Verstöße gegen das Mindestmaß an Schutzmaßnahmen und investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Die Kombination all dieser Faktoren führte zu einer quantitativen Validierung der „Nachhaltigkeit". Sie diente dazu sicherzustellen, dass die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine der ökologischen oder sozialen Nachhaltigkeitsziele wesentlich beeinträchtigen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Berücksichtigung der PAIs durch den Manager bei der Feststellung, ob die nachhaltigen Investitionen des Portfolios keine erhebliche Beeinträchtigung für ökologisch oder sozial nachhaltige Anlageziele im Rahmen der nachhaltigen Investitionen des Portfolios waren, erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung der Emittenten, die unter die vom Manager für jede PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen mit den Emittenten, wenn sie unter die vom Manager für eine PAI festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fielen; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

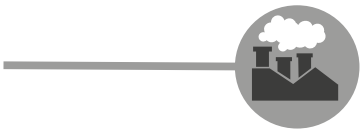
das Portfolio investierte nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Manager) berücksichtigt.

Der Manager berücksichtigte PAIs in Bezug auf das Portfolio auf zwei Arten:

1. Wie oben unter „*Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?*“ erläutert, wurden zur Feststellung, ob die vom Portfolio getätigten nachhaltigen Investitionen nicht zu einer erheblichen Beeinträchtigung der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Investitionsziele führten, alle PAIs berücksichtigt.

2. Der Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird

	PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel, die vom Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („**NACE**“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem über die vier Kalenderquartalsenden des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitt basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
INTESA SANPAOLO SPA MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,69 %	Italien
DPF 21-2 A RegS	k.A.	1,43 %	Niederlande
MYLAN NV RegS	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,42 %	USA
LANDSBANKINN HF RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,25 %	Island
SUMITOMO MITSUI BANKING CORPORATIO RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,24 %	Japan
BANK OF NOVA SCOTIA RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,20 %	Kanada
MIRAV_19-1 A RegS	k.A.	1,19 %	Spanien
FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,12 %	Kanada
ATHENE GLOBAL FUNDING RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,05 %	USA
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL MTN	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,02 %	Frankreich
MORGAN STANLEY MTN	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,00 %	USA
WIZZ AIR FINANCE COMPANY BV MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,98 %	Schweiz
AMCO ASSET MANAGEMENT COMPANY SPA MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,96 %	Italien
HOLCIM FINANCE LUX SA	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,91 %	Schweiz
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE MTN RegS	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	0,90 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

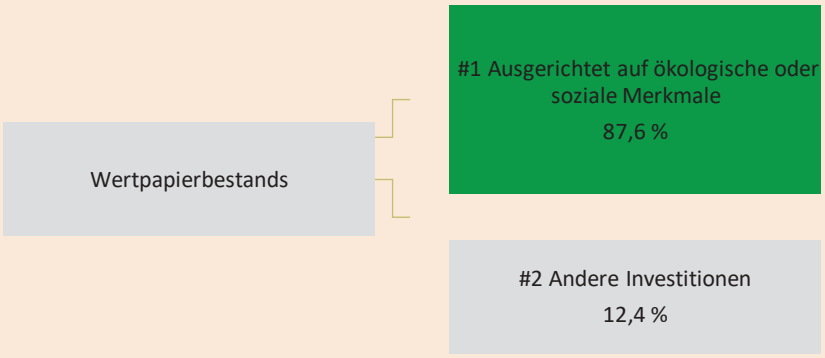
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 70 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 87,6 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 5 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in diesem periodischen Bericht wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts zum dritten und vierten Quartalsende 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 16,6 % an nachhaltigen Investitionen.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 30 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 12,4 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Der Bezugszeitraum für die nachstehenden Daten ist ein Durchschnitt der vier Quartalsenden 2023, mit Ausnahme der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen. In diesem Falle wurden die Daten lediglich für diesen Bezugszeitraum auf Grundlage des Durchschnitts zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 erstellt.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Der prozentuale Anteil der nachhaltigen Investitionen als Durchschnitt des dritten und vierten Quartals 2023 betrug 16,6 %. Darin enthalten sind 12,6 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, und 4,0 % an sozial nachhaltigen Investitionen. Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Bildung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	8,2 %
D – Energieversorgung	2,2 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,3 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	0,5 %
H - Verkehr und Lagerei	1,7 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,1 %
J – Information und Kommunikation	2,0 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	64,6 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	5,0 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	3,7 %
O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung, Sozialversicherung*	6,3 %
R – Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,7 %
U – Exterritoriale Organisationen und Körperschaften	0,7 %
Keine	4,0 %

**O – Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; obligatorische Sozialversicherung wird von Barclays Industry klassifiziert als entweder: Staatsanleihen, US-Staatsanleihen, ausländische Kommunalanleihen, supranationale Titel, ausländische Agenturen.*

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig gelten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung mit der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

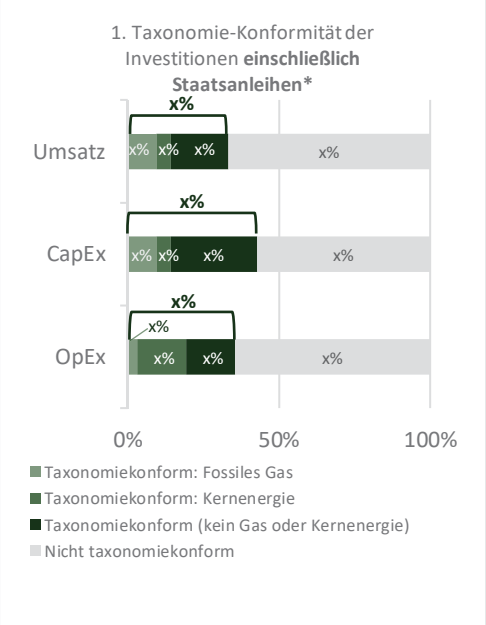
☒ Nein

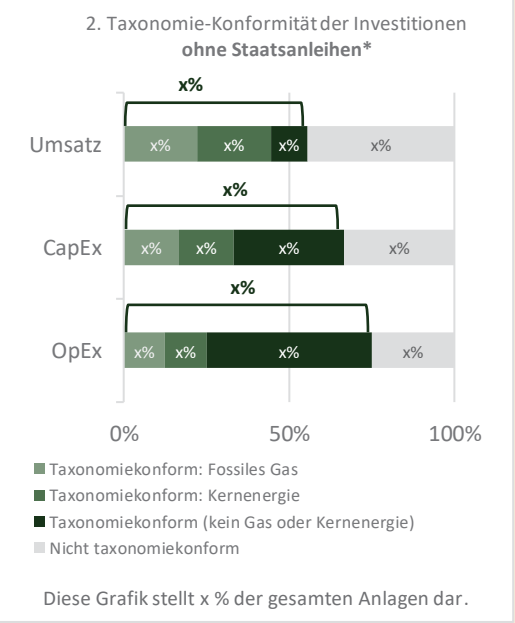
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





* *Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 5 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 12,6 % an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, das nicht mit der EU-Taxonomie konform ist.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Portfolio führte zum 2. August 2023 eine Mindestverpflichtung zu nachhaltigen Investitionen von 5 % ein. Die Angaben zu nachhaltigen Investitionen in dieser periodischen Berichtsvorlage wurden daher auf Grundlage des Durchschnitts aus den Werten zum Ende des dritten und vierten Quartals 2023 (als die einzigen Quartalsenden nach Einführung der Verpflichtung zu nachhaltigen Investitionen) erstellt. Das Portfolio hielt 4,0 % an sozial nachhaltigen Investitionen.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder zur Gewährleistung einer adäquaten Liquidität, Absicherung und Besicherung.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Emittenten, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde genutzt, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Kredit- und Wertbeurteilung besser zu erkennen. Der NB-ESG-Quotient war eine Schlüsselkomponente der internen Kreditratings und half dabei, Geschäftsrisiken (einschließlich ESG-Risiken) zu identifizieren, die zu einer Verschlechterung des Kreditprofils eines Emittenten führen würden. Interne Kreditratings können auf der Grundlage des NB-ESG-Quotient-Ratings herauf- oder herabgestuft werden, was als ein wichtiger Bestandteil des Anlageprozesses für das Portfolio vom Manager überwacht wurde.

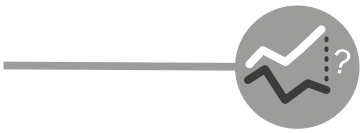
Durch die Integration der hausinternenen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine internen Kreditratings bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Manager arbeitete mit den Emittenten über ein solides ESG-Dialogprogramm zusammen. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung der Mitwirkung verfolgt.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Equity Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300GF328Y6TQJI517

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ Ja	☒ Nein
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient- oder externen Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus überwacht der Sub-Investment-Manager fortlaufend Unternehmen mit einem unterdurchschnittlichen oder schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, um zu verstehen, wie sie besagte ESG-Bedenken mildern/verbessern.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,1	ES: A-D G: 1-4	97 %
Daten von Dritten	6,6	0-10	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES**“) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 6,8 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 96 %. Diese Deckung ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %

Bezugszeitraum 2022	ES: B G: 2,2	6,6	100 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B G: 2,1	6,6	97 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich jedoch verbessert. Die Bewertung der Daten Dritter blieb unverändert. Dies ist auf Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf Unterschiede im externen Rating der Unternehmen.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-5,7 %	91 %
Bezugszeitraum 2023	-6,8 %	96 %

Die CVaR-Prognose hat sich im Vergleich zum Vorjahr aufgrund von einer verbesserten Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen sowie Handelsaktivitäten im Portfolio verändert.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J – Information und Kommunikation	9,2 %	USA
AMAZON COM INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	5,3 %	USA
APPLE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,8 %	USA
ALPHABET INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	4,5 %	USA
META PLATFORMS INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	3,8 %	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,5 %	USA
NVIDIA CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,3 %	USA
SALESFORCE INC	J – Information und Kommunikation	3,3 %	USA
VISA INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,5 %	USA
MASTERCARD INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	2,4 %	USA
SERVICENOW INC	J – Information und Kommunikation	2,4 %	USA
TJX INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,2 %	USA
WORKDAY INC	J – Information und Kommunikation	2,2 %	USA
MCDONALDS CORP	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	2,1 %	USA
ADOBE INC	J – Information und Kommunikation	2,1 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

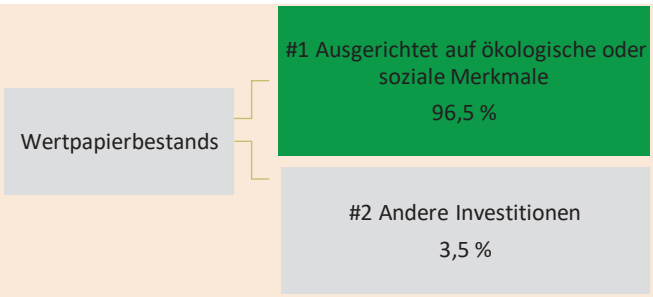
Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 96,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen" erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 3,5 % an „sonstigen Investitionen".

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	22,6 %
D – Energieversorgung	2,0 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	1,6 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	13,7 %

H - Verkehr und Lagerei	1,5 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	2,6 %
J – Information und Kommunikation	41,3 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	12,1 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,4 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	2,0 %
Keine	0,2 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

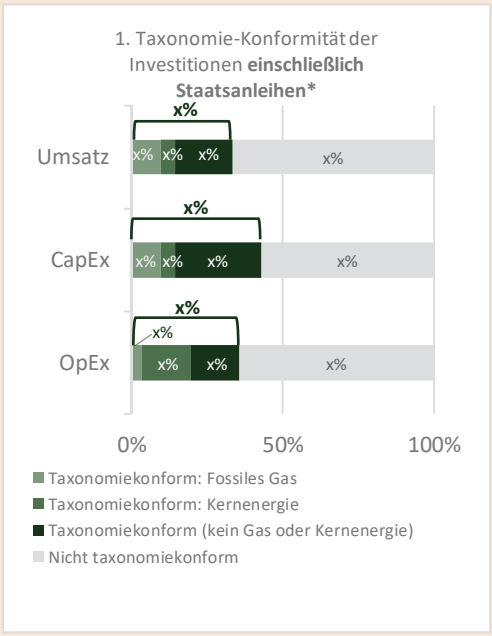
☒ Nein

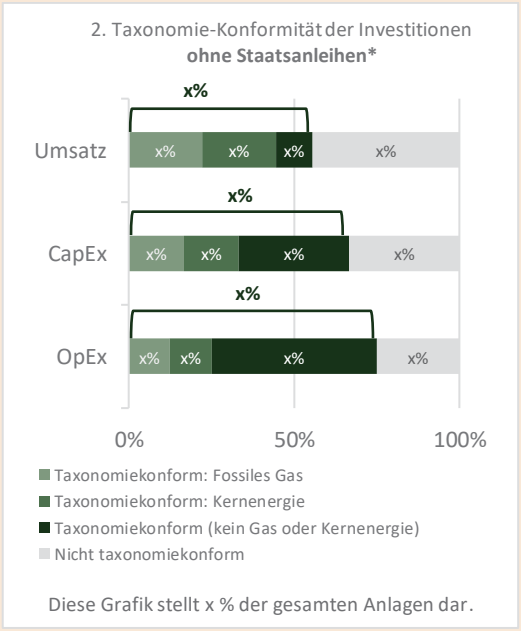
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

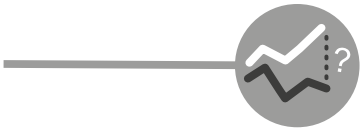
Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient und das externe Rating) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager trat in einen Dialog mit Unternehmen ein. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Large Cap Value Fund (das „**Portfolio**“)
Unternehmenskennung: 549300J88053TDGDPM52

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Chancen und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 2,2	ES: A-D G: 1-4	95 %
Daten von Dritten	6,6	0-10	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 23,8 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als

Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 95 %. Diese Deckung ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %

Bezugszeitraum 2022	ES: B G: 2,0	6,8	100 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B G: 2,2	6,6	95 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich das G-Rating des NB-ESG-Quotienten aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die Bewertung der Daten Dritter aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios sowie aufgrund von potenziellen Änderungen oder Unterschieden im externen Rating der Unternehmen verlagert.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung des NB-ESG-Quotienten und des externen Ratings aufgrund von Veränderungen bei den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verlagert.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-18,5 %	96 %
Bezugszeitraum 2023	-23,8 %	95 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich der prognostizierte CVaR-Verlust aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios erhöht. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Abdeckung aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, wichtigste nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
JOHNSON & JOHNSON	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,1 %	USA
PROCTER & GAMBLE	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,0 %	USA
EXXON MOBIL CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,4 %	USA
MERCK & CO INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,4 %	USA
JPMORGAN CHASE	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,2 %	USA
BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,1 %	USA
DUKE ENERGY CORP	D – Energieversorgung	3,1 %	USA
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,7 %	USA
SEMPRA	D – Energieversorgung	2,7 %	USA
DTE ENERGY	D – Energieversorgung	2,6 %	USA
WALMART INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,6 %	USA
PFIZER INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,5 %	USA
EXELON CORP	D – Energieversorgung	2,4 %	USA
NEWMONT	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,2 %	USA
RIO TINTO ADR REPTG ONE PLC	B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,1 %	Australien

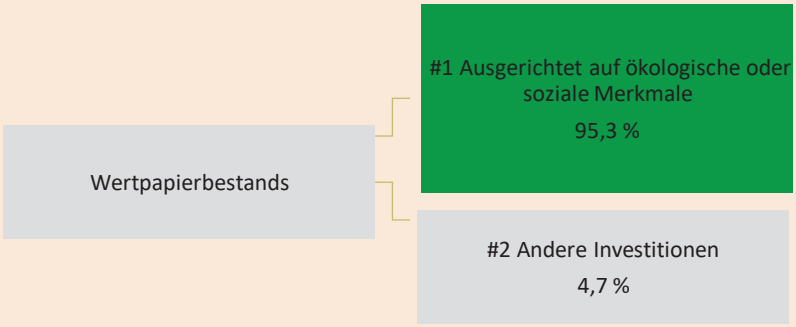
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 75 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 95,3 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.
- Das Portfolio strebt danach, maximal 25 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 4,7 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	8,3 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	48,3 %
D – Energieversorgung	15,8 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,2 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,4 %
H - Verkehr und Lagerei	0,3 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,5 %
J – Information und Kommunikation	4,3 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	15,1 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,1 %

Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,3 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	1,4 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

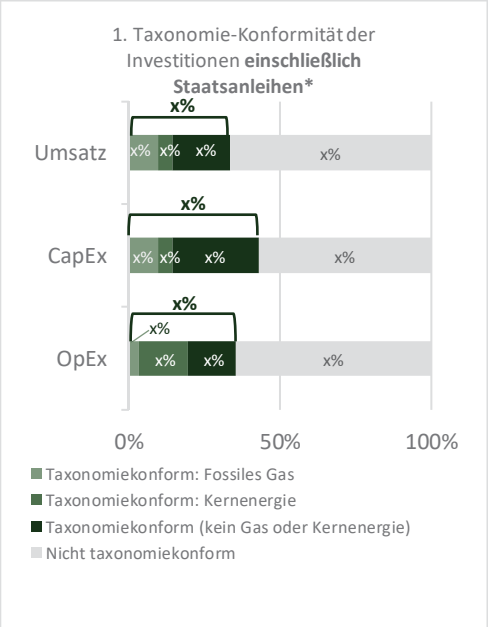
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

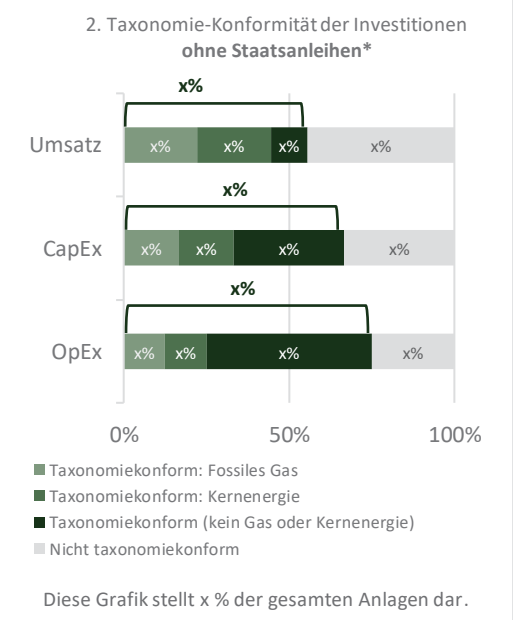
☒ Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





* *Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

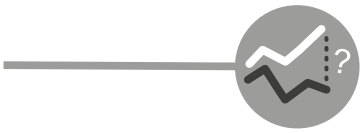
II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Long Short Equity Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 54930034RCIO16VO2Z23

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ Ja	☒ Nein
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“).

Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Der ESG-Rahmen fand auf das Long-Segment des Portfolios Anwendung, das einen mehrjährigen Anlagehorizont verfolgt. Die Short-Positionen des Sub-Investment-Managers werden über Derivate zum Ausdruck gebracht und waren daher nicht zur Berücksichtigung von ESG-Faktoren verpflichtet. Genauere Angaben zur erwarteten Long/Short-Allokation des Portfolios finden sich im Abschnitt „*Anlageansatz*" des Nachtrags.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („NB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentrierte, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen werden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Unternehmen mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient- oder externen Rating hatten eine bessere Chance, in das Long-Segment des Portfolios aufgenommen zu werden. Unternehmen mit einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating, insbesondere dann, wenn ein Unternehmen diesbezüglich keine Maßnahmen ergriff, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Long-Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Long-Segment des Portfolios entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit

einem schlechten NB-ESG-Quotient- oder externen Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	ES: B G:2.2	ES: A-D G: 1-4	81 %
Daten von Dritten	6,3	0-10	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Bewertungen der Daten Dritter reichen von 0 bis 10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 21,5 % führen

könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 68 %. Diese Deckung ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Lediglich Long-Positionen wurden durch die vorstehend aufgeführte NB-ESG-Ausschlusspolitik abgedeckt.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	ES: B G: 2,2	6,5	98 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B G: 2,2	6,3	81 %

Im Vergleich zum Vorjahr blieb das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten unverändert, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten blieb unverändert und die Bewertung der Daten Dritter hat sich verschlechtert. Dies ist auf Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf Unterschiede im externen Rating der Unternehmen.

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die kombinierte Abdeckung durch den NB-ESG-Quotienten und das externe Rating verschlechtert.

Angesichts des Engagements des Portfolios in Short-Positionen (die nicht als Investitionen erachtet werden, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen) kann es eine Herausforderung sein, ein hohes Niveau der kombinierten Abdeckung im gesamten Portfolio aufrechtzuerhalten. Die ESG-Analyse wird intern durchgeführt, mit Unterstützung durch die Daten externer Anbieter, und nicht ausgelagert. Der Sub-Investment-Manager nimmt auf kontinuierlicher Basis Bewertungen dieser ESG-Merkmale vor. Von Zeit zu Zeit kann es vorkommen, dass einem Unternehmen zum Zeitpunkt der Anlage für einen kurzen Zeitraum kein NB-ESG-Quotient-Rating zugewiesen wird. Der Sub-Investment-Manager steht in regelmäßigen Abständen mit externen Anbietern von ESG-Daten in Kontakt, um Themen wie die Datenabdeckung zu diskutieren und Optionen zur Behebung von Datenlücken zu prüfen. Die Nutzung mehrerer externer Anbieter von ESG-Daten ermöglicht es dem Sub-Investment-Manager, die Datenabdeckung und die Qualität der Daten der externen Anbieter von ESG-Daten zu bewerten. Darüber hinaus prüft der Sub-Investment-Manager weiterhin neue ESG-Datenprodukte und externe Anbieter von ESG-Daten, um potenzielle Verbesserungen unserer bestehenden ESG-Datenabdeckung zu bewerten.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-16,6 %	59 %
Bezugszeitraum 2023	-21,5 %	68 %

Der durch die CVaR prognostizierte Verlust ist im Vergleich zum Vorjahr aufgrund einer verbesserten Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und der Handelsaktivitäten im Portfolio gestiegen. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Die CVaR-Abdeckung des Portfolios hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert. Dies ist auf eine verbesserte Datenabdeckung bei einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße.

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – Dieses Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, wichtigste nachteilige Auswirkungen zu berücksichtigen.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.
Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	J – Information und Kommunikation	4,0 %	USA
APPLE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,7 %	USA
AMAZON COM INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,6 %	USA
ALPHABET INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	2,5 %	USA
META PLATFORMS INC CLASS A	J – Information und Kommunikation	2,5 %	USA
SALESFORCE INC	J – Information und Kommunikation	2,4 %	USA
MCDONALDS CORP	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	2,3 %	USA
TJX INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,2 %	USA
ADOBE INC	J – Information und Kommunikation	2,0 %	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,9 %	USA
UNION PACIFIC CORP	H - Verkehr und Lagerung	1,9 %	USA
NEXTERA ENERGY INC	D – Energieversorgung	1,9 %	USA
CME GROUP INC CLASS A	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	1,7 %	USA
KEURIG DR PEPPER INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,7 %	USA
S&P GLOBAL INC	J – Information und Kommunikation	1,7 %	USA

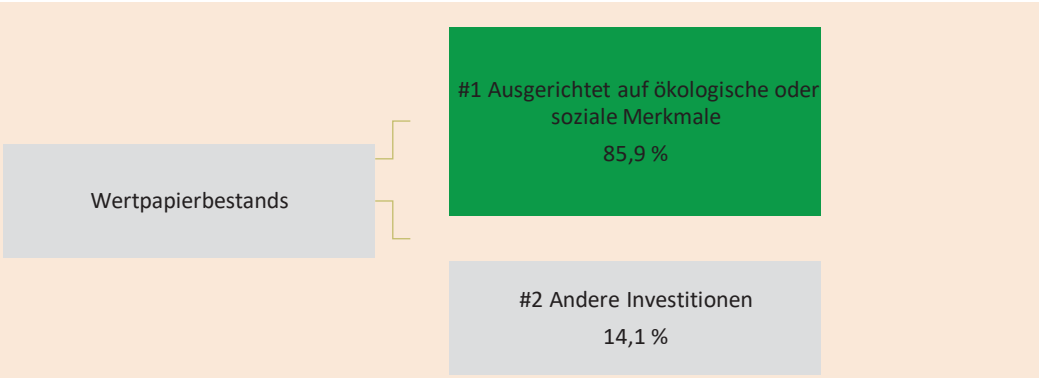
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 60 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 85,9 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 40 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 14,1 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	23,3 %
D – Energieversorgung	5,5 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	1,2 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	12,7 %
H - Verkehr und Lagerei	3,2 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	3,7 %
J – Information und Kommunikation	31,6 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	12,0 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,1 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Dienstleistungen	0,9 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,5 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	0,7 %
S – Sonstige Dienstleistungen	0,2 %
Keine	1,4 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

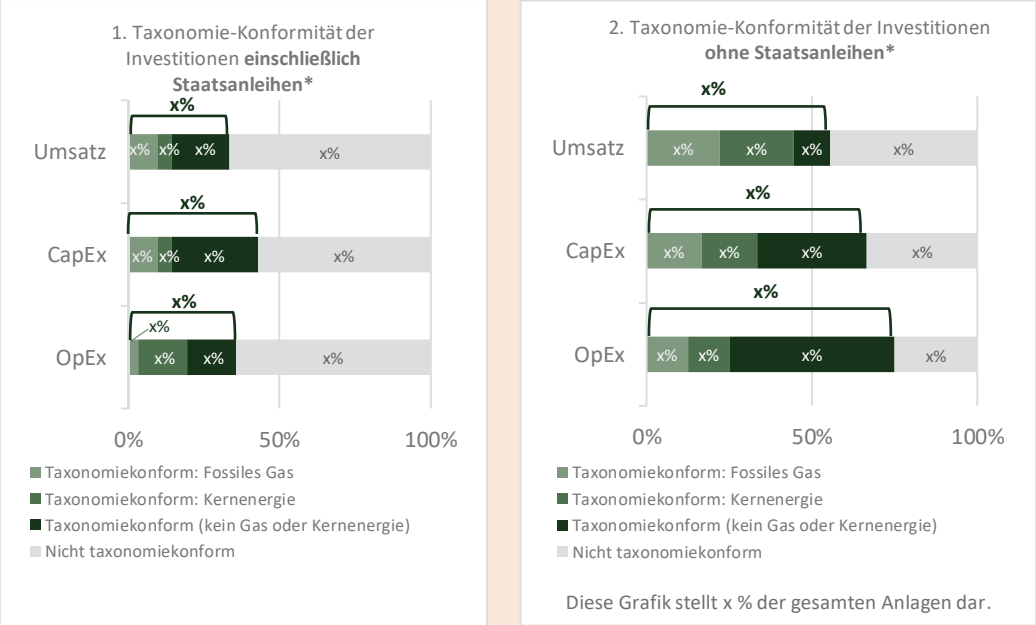
☒ Nein

[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* *Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen" umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte

oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen" im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient- oder externe Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen.

Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient und das externe Rating) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager trat in einen Dialog mit Unternehmen ein. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen

Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses für das Long-Segment. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die im Long-Segment des Portfolios beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Long-Segment des Portfolios die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie vorstehend erwähnt, werden lediglich Long-Positionen durch die vorstehend aufgeführte NB-ESG-Ausschlusspolitik abgedeckt.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300K77TBAIVA0NY51

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___ % an nachhaltigen Investitionen
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES:B G: 2,2	ES: A-D G: 1-4	99 %
Daten von Dritten	6,2	0-10	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**”) das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 15,6 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller

klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige Daten verfügte. Das Portfolio hatte eine CVaR-Abdeckung von 99 %. Diese Deckung ist ein Durchschnitt der CVaR-Abdeckung über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstießen oder nicht mit diesen vereinbar waren. Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	ES: C G: 2,3	6,2	99 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B G: 2,2	6,2	99 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich im Vergleich zum Vorjahr verbessert, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich verbessert und Bewertung der Daten Dritter ist unverändert geblieben. Dies ist auf Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf Unterschiede im externen Rating der Unternehmen.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-12,6 %	99 %
Bezugszeitraum 2023	-15,6 %	99 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich die CVaR-Prognose aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios verändert.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**"):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	5,2 %	USA
ALPHABET INC CLASS C	J – Information und Kommunikation	4,9 %	USA
MICROSOFT CORP	J – Information und Kommunikation	4,4 %	USA
APPLE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,3 %	USA
GRAPHIC PACKAGING HOLDING	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,1 %	USA
HCA HEALTHCARE INC	Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	3,5 %	USA
CSX CORP	H - Verkehr und Lagerung	3,3 %	USA
BROOKFIELD CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,2 %	Kanada
ARAMARK	I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	3,1 %	USA
JPMORGAN CHASE	K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	3,1 %	USA
T MOBILE US INC	J – Information und Kommunikation	3,1 %	USA
MOTOROLA SOLUTIONS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,1 %	USA
AMAZON COM INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,9 %	USA
US FOODS HOLDING CORP	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,7 %	USA
BECTON DICKINSON	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,3 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

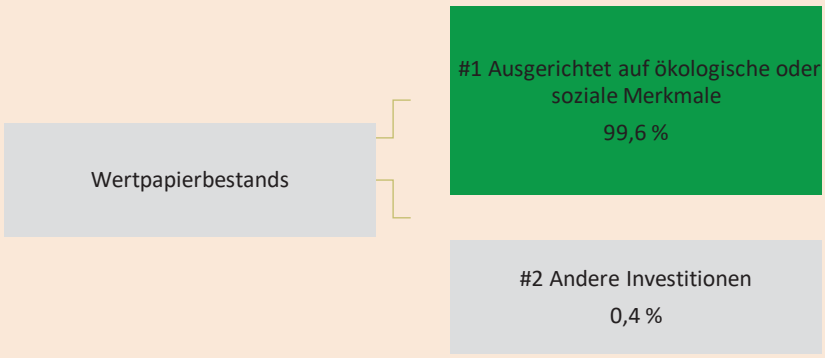
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 99,6 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 0,4 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnungen basierten auf Marktbewertungen des Portfolios und können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten basieren. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,5 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	35,2 %
D – Energieversorgung	1,3 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	11,7 %
H - Verkehr und Lagerei	3,3 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	5,4 %
J – Information und Kommunikation	14,8 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	18,8 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,2 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,4 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	3,5 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

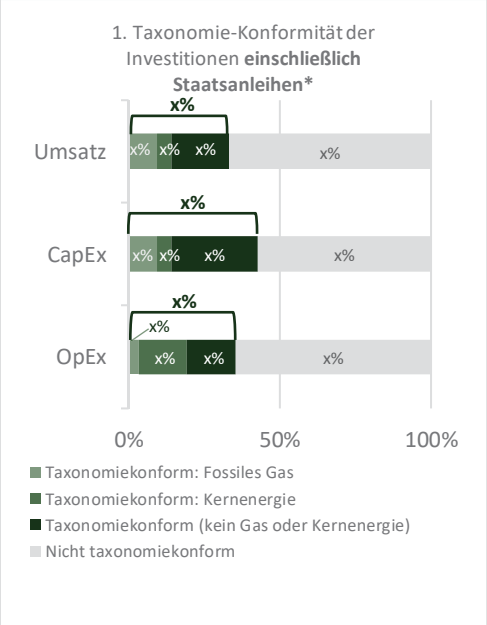
☒ Nein

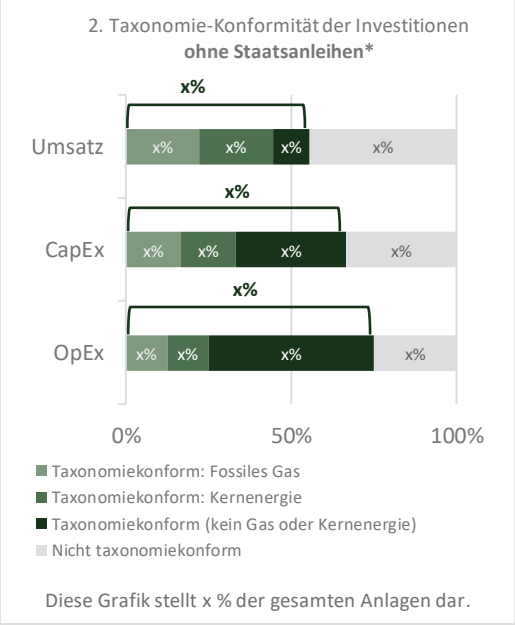
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Real Estate Securities Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300T9PUOV1AK0OR82

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ Ja	☒ Nein
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Alle Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnitt der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**")*, Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, und Materialbeschaffung.
- ***Soziale Merkmale***: Zugang zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette und Vielfalt und Integration der Belegschaft.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Emittenten, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wird unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteten ESG-Daten erstellt. Ergänzend kommen interne qualitative Analysen hinzu, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams des Sub-Investment-Managers genutzt wird. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Emittenten im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtet die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Emittenten wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss. Emittenten mit einem günstigen und/oder einem sich verbessernden NB-ESG-Quotient-Rating hatten eine bessere Chance, in das Portfolio aufgenommen zu werden. Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating, insbesondere dann, wenn ein Emittent diesbezüglich keine Maßnahmen ergreift, wurden mit größerer Wahrscheinlichkeit aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen oder aus dem Portfolio entfernt. Darüber hinaus bemühte sich der Sub-Investment-Manager, konstruktiven Dialogen bei Emittenten mit einem schlechten NB-ESG-Quotient-Rating Vorrang einzuräumen, um zu beurteilen, ob Bedenken angemessen berücksichtigt wurden.

Bezugszeitraum	**Rating**	**Bereich**	**Kombinierte Abdeckung**
NB-ESG-Quotient	ES: B G: 1,6	ES: A-D G: 1-4	97 %
Daten von Dritten	6,2	0-10	

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Im Hinblick auf die NB-ESG-Quotient-Ratings der Aktienemittenten werden für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES“**) die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**“) werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Emittent vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jeden im Portfolio gehaltenen Emittenten erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.

Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. Climate Value-at-Risk:

Während des Bezugszeitraums erfasste Climate Value-at-Risk („**CVaR**") das Ausmaß der Risiken und der Chancen des Klimaübergangs und der physischen Klimarisiken für Unternehmen. CVaR ist ein Instrument für die Szenarioanalyse, mit der wirtschaftliche Risiken und Chancen unter verschiedenen graduellen Szenarien (d. h. dem angestrebten Ausmaß der Erwärmung) und potenziellen regulatorischen Rahmenbedingungen in verschiedenen Ländern bewertet werden.

CVaR ist eine Art von Szenarioanalyse, die als der gegenwärtige Wert der gesamten zukünftigen politischen Risikokosten, der technologischen Opportunitätsgewinne und der Kosten und Gewinne aus extremen Wetterereignissen definiert ist und als Prozentsatz des Marktwerts eines Wertpapiers oder eines Portfolios (d. h. potenzieller Gewinn oder Verlust) je nach dem angestrebten Erwärmungsszenario ausgedrückt wird.

Durch die Berechnung der finanziellen Risiken und der Chancen durch den Klimawandel pro Wertpapier und pro Szenario bietet der CVaR ein Rahmenwerk, das hilft, diese Risiken und Chancen zu quantifizieren und zu verstehen. Die CVaR-Metrik bietet einen Einblick in die durch das Klima bedingte Bewertung von Vermögenswerten auf der Grundlage spezifischer Szenarien. Sie liefert eine Einschätzung, inwieweit ein Wertpapier durch die Auswirkungen des Klimawandels verlieren oder gewinnen könnte.

Für den Bezugszeitraum prognostizierte der CVaR, dass ein Szenario der Klimaerwärmung bei den verwalteten Vermögen zu einem Verlust von 16,3 % führen könnte. Die Daten des Bezugszeitraums wurden basierend auf dem Durchschnittswert zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Diese Analyse beabsichtigt, einen breiten Überblick über den Stil und den Anlageprozess des Investmentteams zu geben.

Die Ergebnisse wurden auf ganzheitlicher Ebene von den Portfoliomanagern und Analysten des Suv-Investment-Managers beurteilt. Die Szenarioanalyse diente als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

Aufgrund von Datenbeschränkungen wurde der CVaR nicht bei allen im Portfolio vertretenen Unternehmen angewandt und stattdessen auf diejenigen Unternehmen beschränkt, für die der Sub-Investment-Manager über ausreichende und zuverlässige

Daten verfügte. Das Portfolio hat eine CVaR-Abdeckung von 95 %. Die CVaR-Abdeckung des Bezugszeitraums ist ein Durchschnitt des CVaR über die vier Kalenderquartalsenden hinweg.

Die Analyse von CVaR (Conditional VaR) wird mindestens einmal im Jahr überprüft.

3. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Emittenten, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Emittenten, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. I Der Sub-Investment-Manager schloss auch Investitionen in Emittenten aus, die private Gefängnisse besitzen, betreiben oder überwiegend wesentliche Dienstleistungen für diese erbringen. Die Gründe sind die erheblichen sozialen Kontroversen und die Reputationsrisiken sowie die Abhängigkeit von der Politik und den Einrichtungen der Justizministerien und der Politik der lokalen Regierung sowie der Umstand, dass diese Einrichtungen nicht ohne weiteres für andere Zwecke umgestaltet werden können.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio hat der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Emittenten verwendet, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich hat der Sub-Investment-Manager versucht, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Emittenten zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Emittenten stützten.

… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D	0-10	0-100 %

	G: 1-4		
Bezugszeitraum 2022	ES: B G: 1,5	6,2	100 %
Bezugszeitraum 2023	ES: B G: 1,6	6,2	97 %

Das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten ist im Vergleich zum Vorjahr unverändert geblieben, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten hat sich jedoch verschlechtert. Die Bewertung der Daten Dritter blieb ebenfalls unverändert. Dies ist auf Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und auf Handelsaktivitäten zurückzuführen sowie auf Unterschiede im externen Rating der Unternehmen.

2. CVaR

	CVaR	**Abdeckung**
Bezugszeitraum 2022	-9,8 %	93 %
Bezugszeitraum 2023	-16,3 %	95 %

Im Vergleich zum Vorjahr hat sich der prognostizierte CVaR-Verlust aufgrund von Veränderungen im Zusammenhang mit den gehaltenen Unternehmen und den Handelsaktivitäten innerhalb des Portfolios erhöht. Wie bereits erwähnt, kann die Szenarioanalyse als Ausgangspunkt für weitere Bottom-up-Analysen und die Identifizierung potenzieller klimabezogener Risiken dienen, um sie durch einen Dialog mit den Emittenten anzusprechen.

3. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Emittenten investiert, deren Aktivitäten als Verstoß gegen die OECD-Leitsätze, die UNGC-Grundsätze, die ILO-Normen und die UNGPs identifiziert wurden oder nicht mit diesen vereinbar waren, die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums 2022 direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Emittenten durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**"):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgas-emissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
AMERICAN TOWER REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	8,4 %	USA
PROLOGIS REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	8,0 %	USA
PUBLIC STORAGE REIT	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	7,2 %	USA
CROWN CASTLE INC	N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	5,6 %	USA
EQUINIX REIT INC	J – Information und Kommunikation	5,3 %	USA
REALTY INCOME REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,9 %	USA
WELLTOWER INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	4,0 %	USA
VICI PPTYS INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,7 %	USA
SIMON PROPERTY GROUP REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,6 %	USA
EXTRA SPACE STORAGE REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,4 %	USA
ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,1 %	USA
APARTMENT INCOME REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,0 %	USA
IRON MOUNTAIN INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	3,0 %	USA
KIMCO REALTY REIT CORP	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,8 %	USA
VENTAS REIT INC	L – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,8 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

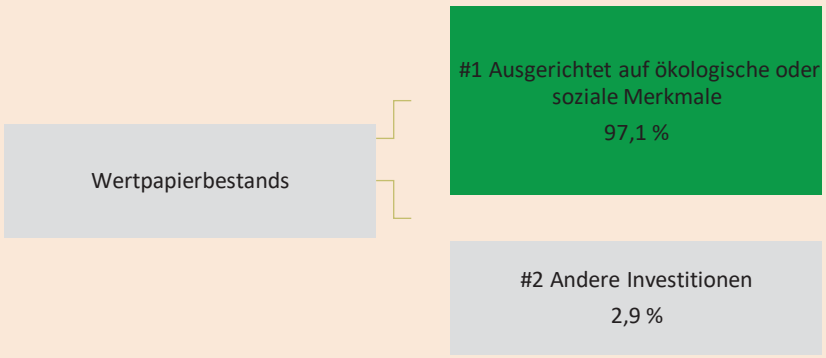
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 97,1 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 2,9 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Emittenten im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnung basierte auf einer Marktbewertung des Portfolios und kann auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Emittenten oder externen Anbietern beruhen. Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,8 %
J – Information und Kommunikation	5,4 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	86,1 %
N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	5,8 %

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Emittenten zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

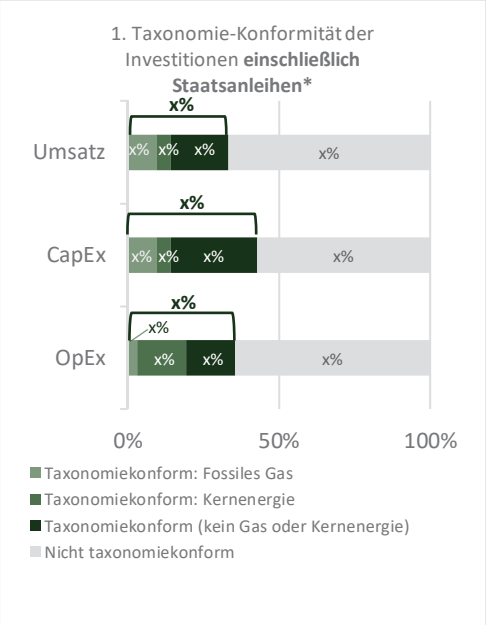
- ☐ Ja:
  - ☐ In fossiles Gas
  - ☐ In Kernenergie
- ☒ Nein

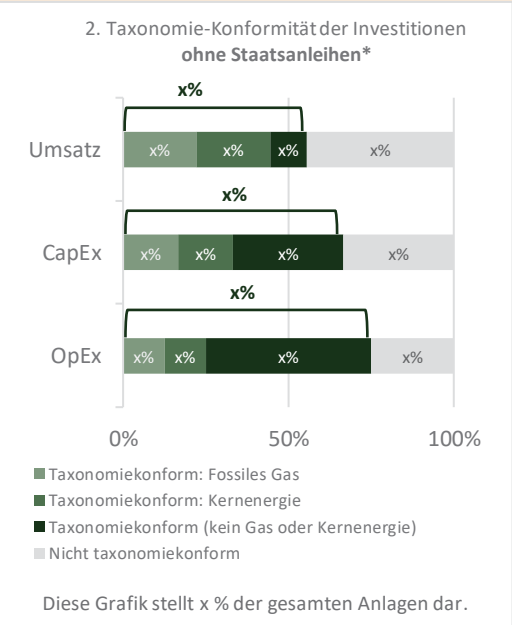
[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

- ***Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von taxonomiekonformen Investitionen verpflichtet.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Emittentenanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten sowie Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Emittenten wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in seine Bewertung bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

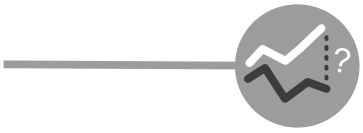
II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager engagierte sich bei den Emittenten durch ein solides ESG-Dialogprogramm. Sie strebten danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die sie für den jeweiligen Emittenten als finanziell wesentlich erachteten. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Emittenten als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Neuberger Berman US Small Cap Fund (das „**Portfolio**“)

Unternehmenskennung: 549300CG2QDECVFZQ378

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine wirtschaftliche Tätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder eines sozialen Ziels beträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keines dieser Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **Ja**	☒ **Nein**
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%	☐ Es **wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es ___% an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
	☐ mit einem sozialen Ziel
☐ Es wurden **damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Die jüngste vorvertragliche SFDR-Vorlage für das Portfolio finden Sie hier.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht bezieht sich auf das Kalenderjahr 2023 (der „**Bezugszeitraum**“). Sofern in der jeweiligen Veröffentlichung nicht anders angegeben, wurden alle Daten des Bezugszeitraums auf Grundlage des Durchschnitts der vier Kalenderquartalsenden berechnet.

Diese Vorlage für den regelmäßigen SFDR-Bericht berichtet über mehrere quantitative ESG-Datenmetriken. Wir haben die Datenabdeckung des Portfolios für diese ESG-Datenmetriken offengelegt, um dem Leser bei der Überprüfung und Bewertung der ESG-Datenmetriken zu assistieren. Die Offenlegung der Datenabdeckung (der ESG-Kennzahlen während des Bezugszeitraums) hat den Zweck, den Leser in die Lage zu versetzen, die Fähigkeit der ESG-Datenmetriken, das Portfolio zu repräsentieren, zu interpretieren und gleichzeitig eventuelle Einschränkungen dieser Datenabdeckung zu berücksichtigen.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die folgenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden vom Portfolio beworben:

- ***Ökologische Merkmale***: Luftqualität, biologische Vielfalt und Landnutzung, Energiemanagement, Umweltrisiken, Kraftstoffeffizienz, Treibhausgasemissionen („**THG**"), Gelegenheiten für saubere Technologien, Schadstoffemissionen und Abfälle, Wasserbewirtschaftung, Management des Verpackungslebenszyklus, Materialbeschaffung und Management des Produktlebenszyklus.

- ***Soziale Merkmale***: Zugang zu Finanzmitteln und zur Gesundheitsversorgung, Beziehungen im Gemeinwesen, Datenschutz und -sicherheit, Anreize für Mitarbeiter und Risikobereitschaft, Gesundheit und Ernährung, Gesundheit und Sicherheit, Entwicklung des Humankapitals, Arbeitsmanagement, Produktsicherheit und -integrität, Arbeitsnormen in der Lieferkette, Vielfalt und Integration der Belegschaft, Preistransparenz und verantwortungsvolles Marketing.

Die Performance bzgl. dieser ökologischen und sozialen Merkmale wurde mit dem NB-ESG-Quotienten gemessen und wird im Folgenden in zusammengefasster Form dargestellt.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Im Rahmen des Anlageprozesses hat der Sub-Investment-Manager eine Reihe von Nachhaltigkeitsindikatoren berücksichtigt, um die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu messen. Diese Nachhaltigkeitsindikatoren sind nachstehend aufgeführt:

1. Der NB-ESG-Quotient:

   Das hausinterne ESG-Ratingsystem von Neuberger Berman (der „**NB- ESG-Quotient**") basiert auf dem Konzept der sektorspezifischen ESG-Risiken und -Gelegenheiten und erstellt ein ESG-Gesamtrating für Unternehmen, indem es diese anhand bestimmter ESG-Kennzahlen bewertet.

   Grundlage des NB-ESG-Quotienten ist die hausinterne Wesentlichkeitsmatrix von Neuberger Berman („MB"), die sich auf die ESG-Merkmale konzentriert, die am ehesten als wesentliche Antriebskraft von ESG-Risiken und -Chancen für jeden Sektor angesehen wurden. Jedes Sektorkriterium wurde unter Verwendung von ESG-Daten Dritter und intern abgeleiteter ESG-Daten erstellt. Ergänzend hinzu kamen interne qualitative Analysen, wobei die beträchtliche Sektorexpertise des Analystenteams für das Portfolio genutzt wurde. Die Wesentlichkeitsmatrix von NB ermöglichte es dem Sub-Investment-Manager, das NB-ESG-Quotient-Rating festzustellen, um Sektoren und Unternehmen im Hinblick auf ihre ökologischen und sozialen Merkmale zu vergleichen.

   Der NB-ESG-Quotient gewichtete die Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale für jeden Sektor, um davon das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen abzuleiten. Das Rating des NB-ESG-Quotienten von Unternehmen wurde zwar im Rahmen des Anlageprozesses berücksichtigt, doch es existiert kein NB-ESG-Quotienten-Mindestrating, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss. Dementsprechend trat der Sub-Investment-Manager in einen Dialog mit Unternehmen ein, die ein schlechtes NB-ESG-Quotient-Rating aufweisen, um eine Verbesserung der zugrunde liegenden ökologischen und sozialen Merkmale (die den NB-ESG-Quotienten ausmachten) zu erreichen.

   Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Bezugszeitraum	Rating	Bereich	Kombinierte Abdeckung
NB-ESG-Quotient	ES: C G: 2,3	ES: A-D G: 1-4	99 %
Daten von Dritten	5,6	0-10	

Im Hinblick auf das NB-ESG-Quotient-Rating für die Bewertung der ökologischen und sozialen Merkmale („**ES"**) werden die Quartile A bis D verwendet, wobei A dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und D dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Zur Bewertung der Governance („**G**") werden die Quartile 1 bis 4 verwendet, wobei 1 dem höchsten Rating (oberstes Quartil) und 4 dem niedrigsten Rating (unterstes Quartil) entspricht. Für dieses Portfolio gibt es kein Mindestrating des NB-ESG-Quotienten, das ein Unternehmen vor einer Investition erreichen muss.

Das durchschnittliche Rating des NB-ESG-Quotienten ist ein gewichteter Durchschnitt, der die ESG-Merkmale widerspiegelt, die als die wichtigsten Antriebskräfte für ESG-Risiken und -Chancen für jedes im Portfolio gehaltene Unternehmen erachtet wurden. Es handelt sich nicht um eine ESG-Bewertung oder ein ESG-Rating des Gesamtportfolios und seiner Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale. Vielmehr ist es eine Bewertung der wesentlichen ESG-Risiken und -Chancen, denen das Portfolio ausgesetzt war.

Daten von externen Anbietern wurden auch verwendet, um die Widerstandsfähigkeit der Portfoliobestände in ihrer Gesamtheit gegenüber langfristigen, finanziell wesentlichen ESG-Risiken zu messen. Die Ratings der Daten durch externe Anbieter reichen von 0-10, wobei 0 die niedrigste und 10 die höchste Bewertung ist.
Die Bewertung und Verwaltung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen ist ein wesentliches Element der Bewerbung ökologischer und sozialer Merkmale durch das Portfolio.

2. ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht wurden, investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Controversial Weapons Policy und die Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren). Abgesehen von der Anwendung der Neuberger Berman Thermal Coal Involvement Policy untersagte der Sub-Investment-Manager die Aufnahme neuer Anlagepositionen in Unternehmen, die (i) mehr als 25 % ihrer Umsätze aus dem Steinkohlebergbau erzielten oder (ii) neue Kapazitäten zur Kohleverstromung hinzufügten. Zudem investierte das Portfolio nicht in Unternehmen, deren Aktivitäten als gegen die Neuberger Berman Global Standards Policy verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit dieser vereinbar waren), wodurch solche Emittenten ausgeschlossen wurden, die gegen (i) die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen („**UNGC-Grundsätze**"), (ii) die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen zu verantwortungsvollem unternehmerischen Handeln („**OECD-Leitsätze**"), (iii) die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte („**UNGPs**") und (iv) die Internationalen Arbeitsnormen („**ILO-Normen**") verstießen. Das Portfolio erwarb keine Wertpapiere mehr von Unternehmen, die Schusswaffen herstellten oder mindestens 5 % ihrer Umsätze durch Tabak, Glücksspiele oder Erwachsenenunterhaltung erzielten.

Bei der Anwendung von ESG-Ausschlüssen auf das Portfolio verwendete der Sub-Investment-Manager die Daten Dritter zur Identifikation von Unternehmen, die gegen die oben dargelegten ESG-Ausschlüsse verstoßen. Wo möglich versuchte der Sub-Investment-Manager, diese Daten Dritter mit der qualitativen Expertise seiner Researchanalysten zu überlagern, um so ein aktuelles und ganzheitliches Bild des Unternehmens zu erstellen. Der Sub-Investment-Manager erörterte und diskutierte die Unterschiede zwischen den anhand der Daten Dritter ermittelten Verstößen und denjenigen, die aufgrund seines eigenen Research ermittelt wurden, die sich auf Daten aus dem NB-ESG-Quotienten und den direkten Kontakt mit dem Unternehmen stützten.

- ***… und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?***

Für den Bezugszeitraum 2022 wurden die offengelegten quantitativen Daten (für die Nachhaltigkeitsindikatoren) zum 31. Dezember 2022 berechnet. Dies ist das einzige Quartalsende im Bezugszeitraum, das auf das Inkrafttreten der SFDR-RTS folgt (sie umfassen die Veröffentlichung der vorvertraglichen SFDR-Vorlagen).

Die nachstehenden quantitativen Daten für die Nachhaltigkeitsindikatoren während des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts der Werte zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

1. NB-ESG-Quotient

	NB-ESG-Quotient-Rating	**Rating der Daten durch externe Anbieter**	**Kombinierte Abdeckung**
Bereich	ES: A-D G: 1-4	0-10	0-100 %
Bezugszeitraum 2022	ES: C G: 2,3	5,4	100 %
Bezugszeitraum 2023	ES: C G: 2,3	5,6	99 %

Im Vergleich zum Vorjahr blieb das ES-Rating des NB-ESG-Quotienten unverändert, das G-Rating des NB-ESG-Quotienten blieb unverändert und die Bewertung der Daten Dritter hat sich verbessert. Dies ist unter Umständen auf Verbesserungen bei den einzelnen im Portfolio gehaltenen Unternehmen gemäß externem Datenanbieter oder auf Differenzen des von dem Anbieter bereitgestellten externen Rating des Unternehmens zurückzuführen.

2. Ausschlüsse

Wie im vorangegangenen Kalenderjahr gab es auch während des Bezugszeitraums keine Verstöße (gegen die oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse).

	Gesamtzahl der Verstöße
Bezugszeitraum 2022	0
Bezugszeitraum 2023	0

- ***Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

  Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend – das Portfolio hat sich nicht zum Halten von nachhaltigen Investitionen verpflichtet.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten, jedoch war der Sub-Investment-Manager nicht in Unternehmen investiert, deren Aktivitäten als gegen die OECD-Leitsätze, die ILO-Normen, die UNGC-Grundsätze und die UNGPs verstoßend identifiziert wurden (oder nicht mit diesen vereinbar waren), die durch die Neuberger Berman Global Standards Policy erfasst werden.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen Umweltziele oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Eine Auswahl der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen wurde während des gesamten Bezugszeitraums direkt (z. B. durch die oben aufgeführten ESG-Ausschlusspolitik) und/oder indirekt (z. B. als Teil der Bewertung von Unternehmen durch den Sub-Investment-Manager) berücksichtigt.

Der Sub-Investment-Manager berücksichtigte die in der nachstehenden Tabelle aufgeführten wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren (die „**PAIs auf Produktebene**“):

PAIs auf Produktebene	
Thema	**Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen**
Treibhausgasemissionen	PAI 1 - THG-Emissionen PAI 2 - CO_2-Fußabdruck PAI 3 - THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird PAI 4 - Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind
Soziales und Beschäftigung	PAI 10 - Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen PAI 13 - Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen PAI 14 - Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene wurde durch die Verfügbarkeit (nach subjektiver Ansicht des Sub-Investment-Managers) von angemessenen, zuverlässigen und überprüfbaren Daten begrenzt. Der Sub-Investment-Manager nutzte Daten von Dritten und Proxydaten sowie internes Research, um die PAIs auf Produktebene zu berücksichtigen.

Die Berücksichtigung der PAIs auf Produktebene durch den Sub-Investment-Manager erfolgte durch eine Kombination aus:

- Überwachung des Portfolios, insbesondere im Fall einer Unterschreitung der quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen, die vom Sub-Investment-Manager für jede PAI auf Produktebene festgelegt wurden;
- Stewardship und/oder Festlegung von Mitwirkungszielen, wenn das Portfolio unter die vom Sub-Investment-Manager für eine PAI auf Produktebene festgelegten quantitativen und qualitativen Toleranzschwellen fiel; und
- Anwendung der oben genannten ESG-Ausschlusspolitik, einschließlich der Berücksichtigung mehrerer PAIs auf Produktebene.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Der Sub-Investment-Manager hat die statistische Systematik der Wirtschaftszweige („NACE“) der EU verwendet, um die Wirtschaftssektoren der 15 wichtigsten Investitionen des Portfolios zu ermitteln.

Da die nachstehende Liste auf einem aus den Daten zum Ende der vier Kalenderquartale des Bezugszeitraums berechneten Durchschnitts basiert, kann sie von den zum 31. Dezember 2023 berechneten Spitzenpositionen der Investitionen des Portfolios im Abschnitt „Aufstellung des Wertpapierbestands“ des Jahresabschlusses abweichen.

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 1. Januar 2023 – 31. Dezember 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,6 %	USA
MANHATTAN ASSOCIATES INC	J – Information und Kommunikation	2,3 %	USA
FAIR ISAAC CORP	J – Information und Kommunikation	2,2 %	USA
POOL CORP	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,1 %	USA
SPS COMMERCE INC	J – Information und Kommunikation	2,0 %	USA
QUALYS INC	J – Information und Kommunikation	1,9 %	USA
CHEMED CORP	Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	1,9 %	USA
RBC BEARINGS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,8 %	USA
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC	G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,8 %	USA
POWER INTEGRATIONS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,7 %	USA
HAEMONETICS CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,7 %	USA
BIO TECHNE CORP	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,7 %	USA
LITTELFUSE INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,6 %	USA
VALMONT INDS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,6 %	USA
EAGLE MATERIALS INC	C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,6 %	USA

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmten Vermögenswerten an.

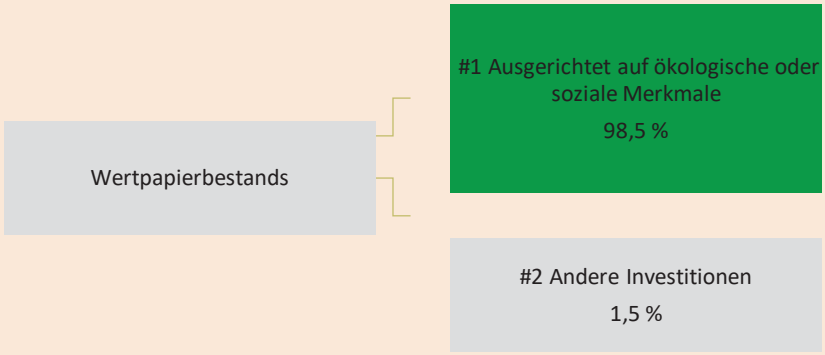
Wie sah die Vermögensallokation aus?

- Das Portfolio strebt einen Anteil von mindestens 80 % für Investitionen an, die mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen auf einer Linie liegen. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 98,5 % an Investitionen, die auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale ausgerichtet waren.

- Das Portfolio strebt danach, maximal 20 % an Investitionen zu halten, die nicht mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang stehen und keine nachhaltigen Anlagen sind. Sie werden unter „Sonstige Investitionen“ erfasst. Während des Bezugszeitraums hielt das Portfolio 1,5 % an „sonstigen Investitionen“.

Der Sub-Investment-Manager berechnete den Anteil der Investitionen mit Ausrichtung auf die vom Portfolio beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale anhand des Anteils der Unternehmen im Portfolio, die i) entweder ein NB-ESG-Quotient-Rating oder ein gleichwertiges ESG-Rating eines Drittanbieters besaßen, das im Rahmen der Portfoliokonstruktion und des Anlageverwaltungsprozesses des Portfolios verwendet wurde, und/oder ii) mit denen der Sub-Investment-Manager direkt zusammengearbeitet hatte. Diese Berechnungen basierten auf Marktbewertungen des Portfolios und können auf unvollständigen oder ungenauen Daten von Unternehmen oder Dritten basieren. Die Daten des

Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Daten des Bezugszeitraums wurden durch die Ermittlung des Durchschnitts aus den Werten zum Ende der vier Kalenderquartale berechnet.

Wirtschaftssektoren - NACE	In % der Vermögenswerte
B – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	4,0 %
C – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	42,8 %
E – Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	0,1 %
G – Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	8,9 %
H - Verkehr und Lagerei	2,2 %
I – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	1,1 %
J – Information und Kommunikation	16,6 %
K – Finanz- und Versicherungsaktivitäten	11,4 %
L – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,7 %
M – Freiberufliche, wissenschaftliche und technische Tätigkeiten	6,5 %

N – Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,8 %
Q – Gesundheitswesen, Heime und Sozialwesen	2,9 %

Um der EU-Taxonomie zu entsprechen, umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** Emissionslimits und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO_2-arme Brennstoffe bis Ende 2035. Für **Kernenergie** beinhalten die Kriterien umfassende Regeln zu Sicherheit und Abfallmanagement.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

- **Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Die durch die EU-Taxonomie eingeführten Analyse- und Offenlegungspflichten sind sehr detailliert. Ihre Einhaltung erfordert die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte bzgl. jeder vom Portfolio getätigten Anlage. Der Sub-Investment-Manager kann nicht bestätigen, dass das Portfolio in Anlagen investiert war, die im Sinne der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig galten. Die Offenlegungen und die Berichterstattung über die Taxonomie-Konformität werden sich in dem Maße entwickeln, wie sich der EU-Rahmen weiterentwickelt und Daten von den Unternehmen zur Verfügung gestellt werden. Der Sub-Investment-Manager wird das Ausmaß, in dem nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung der EU-Taxonomie übereinstimmen, aktiv überprüfen, sobald sich die Verfügbarkeit und Qualität der Daten verbessern.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

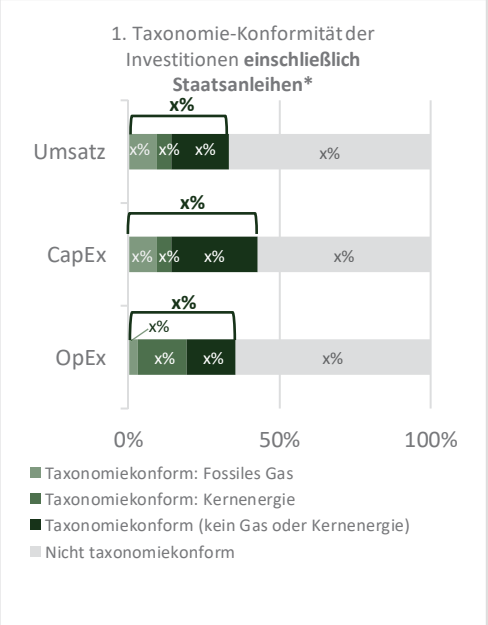
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

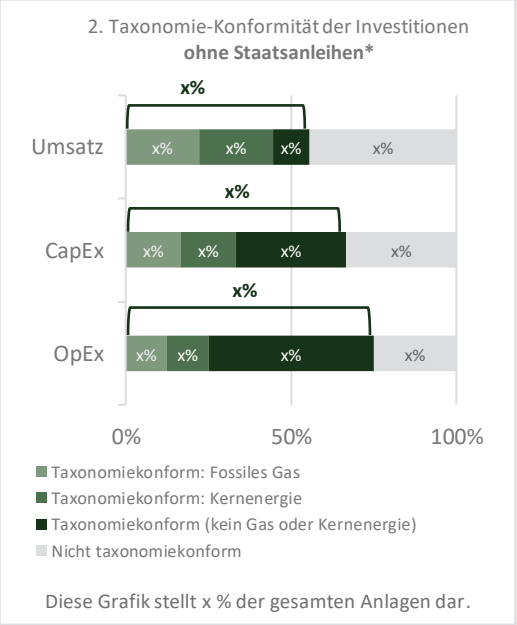
☒ Nein

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Tätigkeiten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Diagramme zeigen in Grün den Prozentsatz der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die TaxonomieKonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.





** Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen" alle Risikopositionen gegenüber Staaten.*

[1] Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und/oder Kernenergie stehen nur dann mit der EU-Taxonomie in Einklang, wenn sie zur Begrenzung des Klimawandels („Klimaschutz") beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe die Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für wirtschaftliche Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilem Gas und Kernenergie, die mit der EU-Taxonomie in Einklang stehen, sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission dargelegt.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich in diesem oder im vorherigen Bezugszeitraum nicht dazu, taxonomiekonforme Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend – Das Portfolio verpflichtete sich nicht dazu, nachhaltige Investitionen zu halten.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„Andere Investitionen“ umfasste die verbleibenden Investitionen des Portfolios (einschließlich, aber nicht beschränkt auf Derivate oder Wertpapiere, die durch einen Pool ähnlicher Vermögenswerte oder Forderungen besichert waren, die im Nachtrag für das Portfolio aufgeführt sind), die weder mit den ökologischen oder sozialen Merkmalen in Einklang standen noch als nachhaltige Investitionen galten.

Die „Anderen Investitionen“ im Portfolio wurden aus einer Reihe von Gründen gehalten, die der Manager als vorteilhaft für das Portfolio erachtete, beispielsweise für das Risikomanagement und/oder, um eine adäquate Liquidität, Absicherung und Besicherung zu gewährleisten.

Wie bereits erwähnt, wurde das Portfolio auf kontinuierlicher Basis unter Einhaltung der ESG-Ausschlusspolitik investiert. Dadurch wurde sichergestellt, dass die vom Portfolio getätigten Investitionen mit internationalen Umwelt- und Sozialstandards wie den UNGC-Grundsätze, den UNGPs, den OECD-Leitsätzen und den ILO-Normen in Einklang stehen.

Der Sub-Investment-Manager ist der Ansicht, dass diese Richtlinien Investitionen in Unternehmen, die in überaus markanter Weise gegen ökologische und/oder soziale Mindeststandards verstoßen haben, verhinderten und sie sicherstellten, dass das Portfolio seine ökologischen und sozialen Merkmale erfolgreich bewerben konnte.

Durch die oben genannten Schritte wurde sichergestellt, dass solide ökologische und soziale Schutzmaßnahmen vorhanden waren.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Das Portfolio wurde in Übereinstimmung mit dem Anlageziel verwaltet, und es wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen:

I. Integration der hausinternen ESG-Analyse:

Der Sub-Investment-Manager wendete bei der Auswahl und der laufenden Überwachung der vom Portfolio getätigten Investitionen einen hohen Due-Diligence-Standard an, um die Integration von Nachhaltigkeitsrisiken (wie in den SFDR definiert) und ESG zu gewährleisten. Der Sub-Investment-Manager versteht unter ESG-Integration die Praxis, wesentliche ESG-Risiken und -Überlegungen (als ein verbindliches Element) in den Anlageentscheidungsprozess zu integrieren. Die ESG-Integration reiht sich neben anderen finanziellen Überlegungen ein und sollte die Unternehmensanalysen durch die Investmentteams des Sub-Investment-Managers bereichern, indem sie die Instrumente zur Identifizierung wesentlicher ESG-Risiken und -Chancen bereitstellt, die in die Investitionsentscheidungen einfließen. Der Sub-Investment-Manager ist der Auffassung, dass wesentliche ESG-Faktoren sowohl aus der Perspektive der Chancen als auch aus Sicht der Risikominderung eine wichtige Antriebskraft für langfristige Anlagerenditen sind. Der ESG-Integrationsansatz des Sub-Investment-Managers berücksichtigt daher ESG-Chancen ebenso wie Nachhaltigkeitsrisiken.

Im Vorfeld einer Investition führt das Investmentteam eine Due-Diligence-Prüfung durch, die es auf der Grundlage der für jede Investition geltenden Fakten und Umstände für angemessen und geeignet hält. Das Investmentteam bewertete die Übereinstimmung der Investitionen mit den vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen, indem es (wie jeweils anwendbar) den NB-ESG-Quotienten und Ausschlussfilter (zur Ermittlung potenzieller Nichteinhaltung der oben aufgeführten ESG-Ausschlüsse) verwendete. Die Due-Diligence-Prüfung wurde durch externe Datenquellen unterstützt.

Das NB-ESG-Quotient-Rating für Unternehmen wurde herangezogen, um die Risiken und Chancen bei der allgemeinen Beurteilung besser zu erkennen. Durch die Integration der hausinternen ESG-Analyse des Investmentteams (der NB-ESG-Quotient) in die Gesamtbetrachtung der Unternehmen bestand eine direkte Verbindung zwischen seinen Analysen der ökologischen und sozialen Merkmale des Portfolios und der Portfoliokonstruktion.

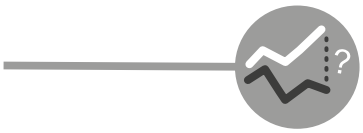
II. Mitwirkung:

Der Sub-Investment-Manager arbeitete mit den Unternehmen mit einem soliden ESG-Dialogprogramm zusammen. Er strebte danach, konstruktiven Gesprächen Vorrang einzuräumen und sich mit Themen (einschließlich ESG-Themen) zu befassen, die er für das jeweilige Unternehmen als finanziell wesentlich erachtete. Der Sub-Investment-Manager betrachtete diesen Dialog mit den Unternehmen als einen wichtigen Teil seines Anlageprozesses. Die Fortschritte wurden vom Sub-Investment-Manager zentral in einem System zur Nachverfolgung des Dialogs erfasst.

III. Sektorale ESG-Ausschlusspolitik:

Um sicherzustellen, dass die vom Portfolio beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erreicht wurden, wandte das Portfolio die oben erwähnte ESG-Ausschlusspolitik an, die das Anlageuniversum einschränkte.

Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?



Nicht zutreffend – Das Portfolio hat keinen Referenzwert.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- ***Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  k.A.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  k.A.

Dieses Dokument wird von der Neuberger Berman Asset Management Ireland Limited („NBAMIL") herausgegeben, die durch die irische Zentralbank (Irish Central Bank, „CBI") zugelassen ist und reguliert wird und in Irland in 2 Central Plaza Dame Street, Dublin 2, eingetragen ist. Vertreter und Zahlstelle in der Schweiz ist BNP PARIBAS, Paris, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, 8002 Zürich, Schweiz. Erfüllungsort und Gerichtsstand für Anteile an den Teilfonds des Fonds, die in oder von der Schweiz aus angeboten oder vertrieben werden, ist der Sitz des Vertreters in der Schweiz. Der Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der Gesellschaft, der letzte geprüfte Jahresabschluss und der danach veröffentlichte Halbjahresabschluss des Fonds sind kostenfrei vom Vertreter in der Schweiz zu beziehen.

Neuberger Berman Investment Funds plc (der „Fonds") ist von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank") als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren gemäß den Vorschriften von 2011 zur Umsetzung der EG-Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (S.I. 352 of 2011) of Ireland) in der jeweils gültigen Fassung („OGAW-Vorschriften") zugelassen.

Dieses Dokument wurde ausschließlich für Informationszwecke zur Verfügung gestellt und/oder richtet sich nur an Personen, bei denen es sich um professionelle Kunden oder zulässige Gegenparteien handelt. Alle Informationen können sich ohne Mitteilung ändern. Kein Teil dieses Dokuments darf ohne die schriftliche Genehmigung von NBAMIL in irgendeiner Form vervielfältigt werden. Unternehmensdaten, wo relevant, einschließlich Zahlen zu Mitarbeitern und verwaltetem Vermögen, spiegeln die zusammengefassten Daten für die verschiedenen verbundenen Anlageberater wider, die Tochtergesellschaften der Neuberger Berman Group LLC (die „Gesellschaft") sind. Die Daten aus der Historie/Zeitachse der Gesellschaft reichen zurück bis ins Jahr 1939, das Gründungsjahr von Neuberger & Berman (dem Vorgänger der Neuberger Berman Group LLC) und verdeutlichen die wesentlichen Expansionen des Unternehmen, einschließlich derer, die aus Übernahmen der verschiedenen verbundenen Anlageberater resultierten, die nun die Gesellschaft bilden. Zu den Anlageexperten auf die Bezug genommen wird, zählen Portfoliomanager, Researchanalysten/Partner, Händler und Produktspezialisten sowie ein Team aus spezialisierten Ökonomen/Strategen.

Neuberger Berman ist der Meinung, dass die Informationen zum Datum ihrer Erstellung richtig sind, aber Neuberger Berman gibt gegenüber dem Empfänger dieses Dokuments oder den Endnutzern diesbezüglich keinerlei Erklärungen oder Zusicherungen ab und übernimmt keinerlei Haftung für Handlungen, die auf Basis der hier enthaltenen Informationen durchgeführt werden. Entscheidungen sollten keinesfalls auf Grundlage der in diesem Dokument enthaltenen Informationen und Meinungen oder der Annahme, dass diese richtig oder vollständig sind, getroffen werden. Hierin zum Ausdruck gebrachte Meinungen entsprechen der Meinung der Neuberger Berman und können sich ohne Vorankündigung ändern. Der Fonds ist möglicherweise in manchen Ländern nicht zum Verkauf zugelassen und ist eventuell nicht für jeden Anlegertyp geeignet. Weitere Informationen sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Zusätzliche Informationen finden Sie auf www.nb.com/europe/literature.html.

Festverzinsliche Wertpapiere unterliegen dem Risiko, dass ein Emittent seine mit der Verbindlichkeit verbundene Verpflichtung zu Kapital- und Zinszahlungen nicht erfüllen kann, und können infolge von Faktoren wie der Zinssensitivität, der Beurteilung der Kreditwürdigkeit des Emittenten durch den Markt und der allgemeinen Marktliquidität (Marktrisiko) Preisschwankungen unterliegen. Festverzinsliche Wertpapiere unterliegen ferner dem Risiko, dass ihr Bonitätsrating oder das ihrer Emittenten herabgesetzt wird, was einen erheblichen Wertverlust solcher Wertpapiere zur Folge haben kann.

Wertpapiere mit niedrigem Rating (Non-Investment-Grade oder High Yield) oder Wertpapiere ohne Rating reagieren mit größerer Wahrscheinlichkeit auf Entwicklungen, die den Markt und das Kreditrisiko beeinflussen, als Wertpapiere mit höheren Ratings, die vor allem auf Veränderungen des allgemeinen Zinsniveaus reagieren. Anleger sollten die relativen Risiken einer Anlage in Hochzinspapieren sorgfältig analysieren und verstehen, dass solche Wertpapiere grundsätzlich nicht für eine kurzfristige Anlage geeignet sind. Anleger, die in einer anderen Währung als der Basiswährung des Fonds zeichnen, sind einem Währungsrisiko ausgesetzt. Schwankungen dieser Wechselkurse können die Kapitalrendite beeinträchtigen.

Die Performance in der Vergangenheit ist kein Indikator für künftige Ergebnisse. Einzelheiten zu den Anlagerisiken, insbesondere zum Liquiditäts-, Zins-, Kredit- und Währungsrisiko, sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Bitte beachten Sie, dass Dividenden/Zinsen, die der Fonds vereinnahmt, Quellensteuern unterliegen können. Die Benchmark berücksichtigt keine steuerlichen Auswirkungen, und deshalb wurde dieser Abzug nicht in der hierin angegebenen Benchmarkrendite berücksichtigt. Das Anlageziel und die Performancebenchmark sind nur ein Ziel und keine Garantie für die Wertentwicklung des Fonds. Der Index wird nicht gemanagt und ein direktes Investment in diesen ist nicht möglich. Indexrenditen gehen von einer Wiederanlage von Dividenden und Veräußerungsgewinnen aus und berücksichtigen im Gegensatz zu Fondsrenditen keine Gebühren oder Kosten. Nachteilige Veränderungen der Wechselkurse können zu einer Verringerung der Rendite und einem Kapitalverlust führen. Die Anlagen jedes Portfolios können vollständig gegenüber seiner Basiswährung abgesichert sein, was die Währungsrisiken reduzieren, das Portfolio aber anderen Risiken aussetzen kann – wie etwa einem Ausfall einer Gegenpartei. Wie vorstehend erwähnt, sind weitere Informationen zu den spezifischen mit dieser Strategie verbundenen Risiken dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen.

Neuberger Berman ist eine eingetragene Marke.

© 2024 Neuberger Berman